

**宝盈基金管理有限公司**

**宝盈国家安全战略沪港深股票型  
证券投资基金更新招募说明书**

**基金管理人：宝盈基金管理有限公司**  
**基金托管人：中国银行股份有限公司**

二零二三年十一月

## 重要提示

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 8 月 25 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2015）1995 号文注册募集。

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的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，属于中高收益/风险特征的基金。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。本基金可投资于港股通标的股票，除了需要承担境内证券市场投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、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，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金资产投资于科创板股票，将面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、退市风险、流动性风险、投资集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包



括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本基金基金名称包含“沪港深”字样仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本基金本次招募说明书（更新）所载内容截止日为 2023 年 11 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 9 月 30 日。本招募说明书（更新）中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经基金托管人复核。

## 目 录

第一部分	绪 言	1
第二部分	释 义	2
第三部分	基金管理人	7
第四部分	基金托管人	20
第五部分	相关服务机构	22
第六部分	基金的募集	24
第七部分	基金合同的生效	28
第八部分	基金份额的申购与赎回	30
第九部分	基金的投资	43
第十部分	基金的业绩	58
第十一部分	基金的财产	59
第十二部分	基金资产估值	60
第十三部分	基金费用与税收	65
第十四部分	基金收益与分配	68
第十五部分	基金的会计和审计	70
第十六部分	基金的信息披露	71
第十七部分	风险揭示	78
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	86
第十九部分	基金合同的内容摘要	88
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	112
第二十一部分	基金份额持有人服务	125
第二十二部分	其他应披露事项	127
第二十三部分	招募说明书存放及查阅方式	128
第二十四部分	备查文件	129

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金的投资目标、投资理念、投资策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书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。基金投资人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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人应按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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：指宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指宝盈基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、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
- 9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性规定》：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

14、沪港股票市场交易互联互通机制：简称沪港通，是指上海证券交易所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，包括沪股通和港股通两部分

15、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，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

22、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

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人

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：指宝盈基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书

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，代为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。基金的登记机构为宝盈基金管理有限公司或接受宝盈基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划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，最长不得超过三个月

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、深圳证券交易所等主要证券交易所及相关金融期货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

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《宝盈基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守



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、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

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、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

54、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

55、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

56、指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。指定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务

57、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

58、基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别

59、A类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

60、C类基金份额：指在投资人申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

61、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

62、基金产品资料概要：指《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

#### 1、基金管理人基本情况

名称：宝盈基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

成立时间：2001 年 5 月 18 日

法定代表人：严震

总经理：杨凯

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

注册资本：10000 万元人民币

电话：0755-83276688

传真：0755-83515599

联系人：杜敏

#### 2、基金管理人股权结构及组织结构

本基金管理人是经中国证监会证监基金字〔2001〕9 号文批准发起设立，现有股东包括中铁信托有限责任公司和中国对外经济贸易信托有限公司。其中中铁信托有限责任公司持有 75% 的股权，中国对外经济贸易信托有限公司持有 25% 的股权。

公司设置公募基金投资决策委员会、专户投资决策委员会、风险管理委员会、信息技术治理委员会、产品委员会、固有资金管理委员会、估值委员会、数据治理委员会，并设置权益投资部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、海外投资部、研究部、REITs 投资部、创新业务部、风险管理部、集中交易部、产品规划部、渠道业务部、机构业务部、市场营销部、互联网金融部、基金运营部、信息技术部、监察稽核部、公司财务部、人力资源部、办公室、北京业务部（北京分公司）、上海业务部和成都业务部等 24 个部室。

### 二、证券投资基金管理情况

截至 2023 年 9 月 30 日，本基金管理人共管理六十只开放式证券投资基金：

宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈中证 100 指数增强型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新锐灵活配置混合型证券投资基金、宝盈医疗健康沪港深股票型证券投资基金、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金、宝盈互联网沪港深灵活配置混合型证券投资基金、宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈人工智能主题股票型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金、宝盈盈润纯债债券型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈研究精选混合型证券投资基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、宝盈祥泽混合型证券投资基金、宝盈鸿盛债券型证券投资基金、宝盈龙头优选股票型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金、宝盈盈旭纯债债券型证券投资基金、宝盈现代服务业混合型证券投资基金、宝盈创新驱动股票型证券投资基金、宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资基金、宝盈发展新动能股票型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈盈沛纯债债券型证券投资基金、宝盈基础产业混合型证券投资基金、宝盈智慧生活混合型证券投资基金、宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈优质成长混合型证券投资基金、宝盈成长精选混合型证券投资基金、宝盈品质甄选混合型证券投资基金、宝盈祥和 9 个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈安盛中短债债券型证券投资基金、宝盈祥琪混合型证券投资基金、宝盈新能源产业混合型发起式证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈聚鑫纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈半导体

### 三、主要人员情况

#### 1、公司董事、监事及高级管理人员

##### (1) 董事会

严震先生，董事长。曾任中铁信托有限责任公司董事会办公室副主任、主任，资产经营部副总经理，风险管理部副总经理，风险管理部总经理、法律合规部总经理，副总法律顾问等职务；现任中铁信托有限责任公司副总经理。

陈赤先生，董事。曾任职于西南财经大学、四川省信托投资公司、和兴证券经纪公司、衡平信托投资有限责任公司；现任中铁信托有限责任公司总经理、党委副书记。

邹纯余先生，董事。曾任职于中铁二局、中铁信托有限责任公司；现任宝盈基金管理有限公司党委书记、董事、副总经理、工会主席、董事会秘书。

马绍晶先生，董事。曾任职于中国对外经济贸易信托有限公司理财中心、资产管理三部、证券产品部、证券信托事业部，曾任外贸信托总经理助理，现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理。

张苏彤先生，独立董事。曾任职于陕西重型机器厂、陕西省西安农业机械厂、陕西财经学院会计系教授、西安交通大学会计学院教授。现任中国政法大学商学院财务会计系教授，中国政法大学法务会计研究中心主任；美国注册舞弊检查师协会（ACFE）会员（CFE）兼北京分会副会长，北京审计协会会员兼企业审计专业委员会理事，教育部学位与研究生教育发展中心学位论文评议专家。

廖振中先生，独立董事。曾任西南财经大学法学院讲师。现任西南财经大学法学院副教授，西南财经大学中国金融法研究中心副主任，西南财经大学 PPP 中心主任。担任迈克生物股份有限公司（深圳交易所：300463）、宝盈基金管理有限公司、成都传媒集团新闻实业公司、乐山农村商业银行、乐山民富村镇银行等上市公司、金融机构独立董事。

曾志耕先生，独立董事。曾任西南财经大学金融学院讲师、副教授、金融学院副院长，现任西南财经大学金融学院教授。

何茵女士，独立董事。曾任北京大学中国经济研究中心讲师、美国科罗拉多大学访问学者、《财经》杂志社宏观研究部经济学家、对外经济贸易大学国际经

杨凯先生，董事。曾任湖南工程学院教师；振远科技股份有限公司销售经理；宝盈基金管理有限公司市场开发部总监、特定客户资产管理部总监、公司总经理助理、研究部总监、基金经理、公司副总经理；中融基金管理有限公司总经理。现任宝盈基金管理有限公司总经理、经营管理层董事。

## （2）监事会

兰敏女士，监事会主席。曾任西南财经大学教师；国金证券投资银行部副经理；中铁信托理财中心经理；平安银行成都分行零售银行部副总经理；富滇银行理财银行部总经理；中铁信托营销总监、财富管理总部总经理、行政总监。现任中铁信托有限责任公司内控审计部总经理。

王法立先生，监事。曾任中国对外经济贸易信托有限公司财富管理中心管理部产品经理、投资管理部信托经理；诺安基金管理有限公司董事会秘书。现任中国对外经济贸易信托有限公司投资管理事业部-股权管理部总经理。

魏玲玲女士，监事。曾任职于深圳石化集团股份有限公司、华夏证券深圳振华路营业部。现任宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

汪兀先生，监事。曾任职于宝盈基金管理有限公司监察稽核部、融通基金管理有限公司监察稽核部。现任宝盈基金管理有限公司监察稽核部总经理、风险管理部总经理。

## （3）高级管理人员

严震先生，董事长（简历请参见董事会成员）。

杨凯先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

邹纯余先生，副总经理（简历请参见董事会成员）。

葛俊杰先生，副总经理。曾任深圳市政府外事办公室主任科员；深圳市政府金融发展服务办公室主任科员、副处长；宝盈基金管理有限公司研究员、总经理办公室主任、专户投资部总监、投资经理。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。

李俊先生，副总经理。曾任职于珠海巨人集团有限公司、深圳中鼎实业发展有限公司、深圳市国际企业股份有限公司、联合证券、汉唐证券、南方基金管理有限公司、南方资本管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。

张磊先生，督察长。曾任职于广东茂名石化公司、新疆邮政储汇局、新疆邮政局、中国证监会新疆监管局、华融证券股份有限公司、上海石上投资管理有限

公司。现任宝盈基金管理有限公司督察长、纪委书记。

张献锦先生，首席信息官。曾任职于铁道部株洲车辆厂、深圳大学通信技术研究所、中国平安保险（集团）股份有限公司、博时基金管理有限公司。现任宝盈基金管理有限公司首席信息官兼信息技术部总经理。

彭玖雯女士，财务负责人。曾就职于达州市人民银行、成都市金通信托投资公司、中铁信托有限责任公司，现任公司财务负责人兼公司财务部总经理、成都业务部总经理。

## 2、基金经理简历

容志能先生，浙江大学电子科学与技术专业硕士。具有 7 年证券从业经历，曾在广东省电力设计研究院担任网络工程项目经理，在广发证券股份有限公司担任家电行业研究员，在中国中投证券有限公司担任通信行业研究员，在天风证券股份有限公司担任通信行业联合首席，现任宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金、宝盈创新驱动股票型证券投资基金基金经理。

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间：

陈金伟，2020 年 11 月 21 日至 2023 年 3 月 31 日；

曹潜，2018 年 2 月 13 日至 2020 年 11 月 27 日；

易祚兴，2016 年 6 月 30 日至 2018 年 3 月 3 日；

张小仁，2016 年 1 月 20 日至 2017 年 3 月 8 日。

## 3、投资决策委员会

本基金管理人公募基金投资决策委员会成员包括：

杨凯先生（主席）：宝盈基金管理有限公司总经理。

葛俊杰先生（委员）：宝盈基金管理有限公司副总经理。

朱建明先生（委员）：宝盈基金管理有限公司权益投资部副总经理（主持工作），宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金、宝盈新能源产业混合型发起式证券投资基金、宝盈成长精选混合型证券投资基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金基金经理；投资经理。

邓栋先生（委员）：宝盈基金管理有限公司固定收益部总经理，宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈融源可转债债券型证券投资基金、宝盈祥明一年定期开放混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥庆9个月持有期混合型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈祥和9个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

蔡丹女士（委员）：宝盈基金管理有限公司量化投资部副总经理（主持工作），宝盈中证100指数增强型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈国证证券龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、宝盈祥和9个月定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥庆9个月持有期混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金基金经理。

张戈先生（委员）：宝盈基金管理有限公司研究部总经理兼专户投资部总经理，投资经理。

魏玲玲女士（委员）：宝盈基金管理有限公司集中交易部总经理。

何相事先生（秘书）：宝盈基金管理有限公司研究部总经理助理（行政主管）。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 四、基金管理人职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，本基金管理人应履行以下职责：

- 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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 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、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、中国证监会规定的其他职责。

#### 五、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将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) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、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，恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反法律法规、基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密和尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本基金管理人制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

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

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、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、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄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；

(4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 六、基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范、稳健运作，有效防止和化解公司经营过程中的风险，最大程度保护基金持有人的合法权益，根据《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规及《宝盈基金管理有限公司章程》，制定《宝盈基金管理有限公司内部控制大纲》，作为公司经营管理的纲领性文件，是制定各项规章制度的基础和依据。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

##### 1、内部控制目标

公司实行内部控制的目标是：

(1) 保证公司经营管理的合法合规性；

(2) 保证基金份额持有人、资产委托人的合法权益不受侵犯；

(3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；

(4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；

(5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

## 2、内部控制原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并适用于公司每一位员工；

(2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

(4) 有效性原则：内部控制制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行修改和完善。

## 3、公司内部控制制度体系及管理

公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门的根据业务的需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，后者的内容不得与前者相违背。

公司各项制度的制订必须满足以下几个要求：

- (1) 符合国家法律、法规和监管部门的有关规定；
- (2) 符合公司业务发展的需要；
- (3) 符合全面、审慎、适时性原则；
- (4) 授权、监督、报告、反馈主线明确；
- (5) 权利与职责、考核、奖惩相对应。

公司章程的修改须经股东会审议通过并报监管部门批准后实施。公司内部控制大纲和公司基本制度的制定与修订由公司总经理提出议案，报董事会通过后实施。公司各机构、部门的制度及其实施细则由各机构、部门负责人依据公司章程和内部控制大纲提出议案，根据公司制度规定的审批程序审批后实施。

监察稽核部定期或不定期对公司制度进行检查、评价。监察稽核部的报告报公司总经理和督察长，总经理向有关机构、部门提出修改意见，由相关机构和部门负责落实。各机构、各部门定期对涉及到本机构、本部门的制度进行检查和评价，并负责落实有关事项。

#### 4、内部控制基本要点

公司的监督系统、决策系统、业务执行系统包括公司对人、财、物的管理、对各种委托资产的管理和基金的发起、设立、销售、投资、清算、宣传等内容。

(1) 授权制度贯穿于公司经营活动的始终。公司授权控制主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会、经营管理层必须有明确的授权制度，确保权责分明；

②公司实行法人授权负责制，公司各业务部门、各级分支机构在其规定的业务、财务、人事等授权范围内行使相应的经营管理职能；

③各项经济业务和管理程序必须遵从公司制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行；

④公司应对授权建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改。

(2) 对人力资源管理的控制主要包括：

①实行全员劳动合同制；

②实行员工绩效管理；

③建立导向明确、奖惩并举、奖罚分明的考核制度；

④建立系统的培训制度，不断提高员工的综合素质。

(3) 对员工行为操守的控制必须包括：

①制定公司员工行为守则，规范员工的行为；

②定期对公司员工进行职业道德培训；

③制定纪律程序，建立举报制度；

④员工不得购买股票或投资封闭式基金。员工购买开放式基金的，持有开放式基金份额的期限不得少于6个月（货币基金除外），并应按照法规或监管机关有关要求申报。

(4) 公司对研究、投资与交易的控制必须包括：

①研究工作应保持独立、客观；

②确立科学的投资理念，决策过程必须标准化、程序化、科学化；

③明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度；

④投资禁止和投资限制制度；

⑤基金经理的选拔、考核、激励制度；

⑥明确的报告体系、监督和反馈体系；

⑦实行空间隔离制度（防火墙制度）；

⑧实行集中交易制度；

⑨标准化、程序化的业务流程；

⑩严格的信息资料的传递、保管、销毁制度。

（5）对新产品开发的控制主要包括：

①新产品开发必须符合国家法律、法规的规定；

②新产品推出前应进行充分的可行性论证，进行风险识别，提出风险控制措施，并按决策程序报批。

（6）对销售和客户服务的控制主要包括：

①建立销售规则和销售人员资格标准；

②加强对代销机构的监督管理；

③建立客户服务标准，做好客户服务工作；

④做好对销售、客户服务信息资料的管理工作。

（7）对注册登记的控制主要包括：

①做好账户管理工作；

②加强对交易与非交易过户的注册登记过户；

③加强对账户、注册登记资料的管理；

④加强对有关账户、注册登记信息的传递管理。

（8）对资讯控制的内容包括：

①实行保密制度，对信息资料分密级进行管理；

②实行门禁制度；

③对公司办公电话进行录音；

④实行电脑系统权限管理。

（9）对财务控制的内容包括：

①公司根据国家颁布的会计准则和财务通则，严格按照公司财务和基金及其他受托资产财务以及基金之间、受托资产之间财务相互独立的原则制定会计制度、

财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计控制体系；

②建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督；

③严格制定财务收支审批制度和费用报销管理办法，自觉遵守国家财税制度和财经纪律；

④强化财产登记保管和实物资产盘点制度；

⑤实行统一采购和招标制度；

⑥制定完善的会计档案保管和财务交接制度等。

(10) 对电子信息系统控制包括：

①根据国家有关法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定电子信息系统的管理规章、操作流程、岗位手册和风险控制制度；

②电子信息系统的的项目立项、设计、开发、测试、运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分软件设计、业务操作和技术维护等方面的职责；

③强化电子信息系统的相互牵制制度，建立系统设计、软件开发等技术人员与实际业务操作人员相互独立制；

④建立计算机系统的日常维护和管理，禁止同一人同时掌管操作系统口令和数据库管理系统口令；

⑤建立电子信息系统的的安全和保密制度，保证电子信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确的传递到各职能部门；

⑥严格计算机交易数据的授权修改程序，建立电子信息数据的定期查验制度；

⑦指定专人负责计算机病毒防范工作，建立定期病毒检测制度等。

(11) 对监督系统的控制包括：

①建立不同层次的监督系统，各层次依据各自的授权范围实施监督；

②强化内部监督系统职能，从公司不同角度对公司不同层面进行持续监督、检查，确保公司各项经营管理活动有效运行；

③全面推行监督、检查工作的责任管理制度，严格监督人员的奖惩制度；

④确保任何部门和人员不得拒绝、阻挠、破坏内部监督工作；

⑤建立道路通畅的报告、反馈系统。

(12) 对突发事件和灾难风险的控制包括：

①制定公司危机处理方案，对突发事件和灾难风险进行提前防范；

②成立危机领导小组和危机处理工作小组，当发生突发事件和灾难时，根据危机处理方案，尽快排除风险，使公司的经营活动恢复正常。

#### 5、持续的控制检验

基金管理人内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验。

公司风险管理委员会、督察长对公司的内部控制实行全方位的定期检查、评价，对重点项目实行定期和不定期的检查、评价，对检查、评价结果出具专题稽核报告，并报全体董事。董事会对报告进行讨论，并将讨论结果委托公司总经理落实。

公司监察稽核部定期对公司的内部控制进行总结，并出具专题报告，并报公司总经理办公会讨论。公司总经理根据办公会议意见，并依据大纲中规定的有关权限和程序责成相关部门落实。

在出现新的市场环境、新的金融工具、新的技术应用、新的法律法规等情况下，风险管理委员会和督察长应组织对公司的内部控制制度进行相关检查，并根据需要进行制度调整。

坚持重点检验的原则，对投资管理、产品设计、基金及其他资产管理业务的销售、投资人服务及其利益保护、公司财务会计、基金会计等重要的业务进行重点持续检验。

#### 6、基金管理人关于内部控制制度声明

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### 三、证券投资基金托管情况

截至2023年9月30日，中国银行已托管1061只证券投资基金，其中境内基金1008只，QDII基金53只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### 四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的



组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金份额，并在基金管理人网站公示。

#### 1、直销机构

直销机构：宝盈基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

法定代表人：严震

总经理：杨凯

成立日期：2001 年 5 月 18 日

客户服务统一咨询电话：400-8888-300（全国统一，免长途话费）

传真：0755-83515880

联系人：曾庆全、李雪丹

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

#### 2、其他销售机构

其他销售机构具体名单详见基金管理人网站。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公示。

### 二、其他相关机构

#### 1、登记机构

登记机构名称：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 层

法定代表人：严震

电话：0755-83276688

传真：0755-83516044

联系人：陈静瑜

#### 2、律师事务所和经办律师

律师事务所名称：上海源泰律师事务所

注册地址：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

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

### 3、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

#### 单元 01 室

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

法定代表人：李丹

联系电话：（021）23238888

经办注册会计师：周祎、肖菊

联系人：肖菊

## 第六部分 基金的募集

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》等有关规定及基金合同，并经中国证监会 2015 年 8 月 25 日证监许可〔2015〕1995 号文注册募集。

本基金份额的初始面值为人民币 1.000 元。

本基金自 2015 年 12 月 21 日起向社会公开募集，截至 2016 年 1 月 15 日，基金募集工作已顺利结束。本次募集净认购金额为 291,375,943.50 元人民币，有效认购户数为 2,886 户。认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 72,793.80 元，折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。上述资金已于 2016 年 1 月 19 日全额划入本基金在托管人中国银行开立的宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金托管专户。按照每份基金单位面值人民币 1.00 元计算，本次募集期募集的基金份额及利息转份额共计 291,448,737.30 份。其中，宝盈基金管理有限公司基金从业人员认购持有的基金份额总额为 990.75 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.00034%。

### 一、基金的募集期

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。

基金管理人可根据基金销售的实际情况在募集期限内适当缩短发售时间并及时公告。

### 二、基金的发售方式和销售渠道

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站公示的基金销售机构信息或基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。本基金的具体发售方式和销售机构详见发售公告。

### 三、基金的发售对象

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

### 四、基金的募集规模限制

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。本基金首次募集份额不设上限。

### 五、基金类别

股票型证券投资基金

### 六、基金的运作方式

契约型开放式

### 七、基金存续期间

不定期

### 八、认购费用

本基金认购费率最高不高于 1.20%，且随认购金额的增加而递减，如下表所示：

费用类别	费率（设认购金额为 M）	
认购费	M < 100 万	1.20%
	100 万 ≤ M < 200 万	0.80%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.60%
	M ≥ 500 万	固定费用 1000 元/笔

募集期投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

### 九、募集期认购款项的利息处理方式

本基金基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专门账户，不得动用。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基金登记机构的记录为准。

### 十、基金认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

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

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) / 基金份额初始面值

认购费用为固定金额时，计算公式为：

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) / 基金份额初始面值

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

示例：某投资人投资 1 万元认购本基金，认购费率为 1.20%，假定募集期间认购资金所得利息为 3 元，则根据公式计算出：

净认购金额 =  $10,000 / (1 + 1.20\%) = 9,881.42$  元

认购费用 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  元

认购份额 =  $(9,881.42 + 3) / 1.00 = 9,884.42$  份

即：投资人投资 1 万元认购本基金，可得到 9,884.42 份基金份额。

## 十一、基金份额认购原则及程序

### 1、认购时间安排

投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机构确定，请参见本基金的发售公告。

### 2、基金份额的认购采用金额认购方式

投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。认购一经受理不得撤销。

### 3、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的发售公告。

### 4、认购的确认

当日（T 日）在规定时间内提交的申请，投资人通常应在 T+2 日到网点查询认购申请的受理结果。

基金销售机构对认购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购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，由于投资

人未及时查询造成的损失由投资人自行承担。

#### 5、认购金额的限制

在直销和代销机构首次认购的单笔最低认购金额为人民币 1,000 元（含认购费），追加认购的单笔最低认购金额为人民币 1,000 元（含认购费）。若发生比例确认，认购金额不受最低认购金额限制。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

## 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，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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，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。

根据《基金法》、《运作办法》和本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2016 年 1 月 20 日获中国证监会机构部函[2016]99 号文书面确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 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》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解



宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书  
决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。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公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 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、深圳证券交易所等主要交易日的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 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申购开始公告中规定。

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

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

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

### 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各类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则。

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 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、赎回申请无效。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，否则所提交的申购申请无效。投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效。投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回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。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往投资人银行账户。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的

有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

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购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

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确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 五、申购与赎回的数额限制

### 1、申购数额限制

投资人通过销售机构申购本基金时，首次申购的最低金额为 1 元，追加申购最低金额为 1 元，各销售机构在不高于上述规定的前提下，可根据自己的情况调整首次最低申购金额和最低追加申购金额限制；通过直销机构申购本基金，首次申购的最低金额为 1 元，追加申购最低金额为 1 元。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人的累计持有份额不设上限限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 六、申购费用与赎回费用及其用途

### 1、基金份额类别

本基金自 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，并将原有基金份额调整为 A 类基金份额，具体参见基金管理人于 2021 年 9 月 17 日发布的《关于宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金增设 C 类基金份额及调整基金份额净值精度并修改基金合同、托管协议的公告》。

本基金根据申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

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

## 2、申购费率

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，A 类基金份额的申购费率最高不高于 1.50%，且随申购金额的增加而递减。投资人重复申购的，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

费用类别	费率（设申购金额为 M）	
A 类基金份额 申购费	M < 100 万	1.50%
	100 万 ≤ M < 200 万	1.00%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.80%
	M ≥ 500 万	固定费用 1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，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、注册登记等各项费用。本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

基金管理人网上交易平台详细费率标准及费率标准调整，请查阅网上交易平台及相关公告。

### 3、赎回费率

本基金对 A 类基金份额、C 类基金份额分别收取赎回费，赎回费率随持有期限的增加而递减。

本基金 A 类基金份额的赎回费率最高不超过 1.50%，按 A 类基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

费用	费率		
	A 类基金份额 赎回费	持有期限<7 日	1.50%
7 日≤持有期限<30 日		0.75%	
30 日≤持有期限<90 日		0.50%	75%计入基金资产
90 日≤持有期限<180 日		0.50%	50%计入基金资产
180 日≤持有期限<365 日		0.20%	25%计入基金资产
365 日≤持有期限<730 日		0.10%	
持有期限≥730 日		0%	-

本基金 C 类基金份额的赎回费率最高不超过 1.50%，按 C 类基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

费用	费率		
	C 类基金份额 赎回费	持有期限<7 日	1.50%
7 日≤持有期限<30 日		0.50%	
持有期限≥30 日		0%	-

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在投资人赎回本基金份额时收取，其中未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

### 七、申购份额与赎回金额的计算

#### 1、A 类基金份额的申购份额的计算

本基金 A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购的有效份额为净申购金额除以当日 A 类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份。申购份额计算结果均按四舍五入法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(1) 申购费用适用比例费率时，计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

示例：某投资人投资 1 万元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 1.50%，

假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.1550 元，则根据公式计算出：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.50\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.1550 = 8,530.06 \text{ 份}$$

即：投资人投资 1 万元申购本基金 A 类基金份额，可得到 8,530.06 份 A 类基金份额。

(2) 申购费用适用固定金额时，计算公式为：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

示例：某投资人投资 600 万元申购本基金 A 类基金份额，申购费用为 1,000 元，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0005 元，则根据公式计算出：

$$\text{申购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 6,000,000 - 1,000 = 5,999,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 5,999,000.00 / 1.0005 = 5,996,002.00 \text{ 份}$$

即：投资人投资 600 万元申购本基金 A 类基金份额，可得到 5,996,002.00 份 A 类基金份额。

## 2、C 类基金份额的申购份额的计算

本基金 C 类基金份额不收取申购费，申购的有效份额为净申购金额除以当日 C 类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份。申购份额计算结果均按四舍五入法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

其申购份额的计算公式为：

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

示例：某投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假定申购当日 C 类基金份额净值为 1.0015 元，则根据公式计算出：

$$\text{申购份额} = 100,000.00 / 1.0015 = 99,850.22 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，可得到 99,850.22 份 C 类基金份额。

## 3、赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类

基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

其赎回金额计算公式为：

赎回金额 = 赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额×赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额-赎回费用

示例：某投资人赎回 1 万份本基金 A 类基金份额，持有时间为 160 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.0560 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.0560 = 10,560.00$  元

赎回费用 =  $10,560 \times 0.50\% = 52.80$  元

净赎回金额 =  $10,560 - 52.80 = 10,507.20$  元

即：投资人赎回 1 万份本基金 A 类基金份额，可得到的净赎回金额为 10,507.20 元。

示例：某投资人赎回 1 万份本基金 C 类基金份额，持有时间为 60 日，赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回金额= $10,000 \times 1.0600 = 10,600.00$  元

赎回费用=0 元

净赎回金额= $10,600.00 - 0 = 10,600.00$  元

即：投资人赎回 1 万份本基金 C 类基金份额，可得到的净赎回金额为 10,600.00 元。

#### 4、基金份额净值的计算

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日（包括该日）内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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。具体计算公式为：

某类基金份额的基金份额净值 = 该类基金份额的基金资产净值/发行在外的该类基金份额的基金份额总数。



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

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响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、赎回费率。

#### 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申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、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。

4、因基金收益分配、基金投资组合内某个或某些证券即将上市等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人的利益。

5、本基金投资的证券、期货市场或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理申购业务。

6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时。

7、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

8、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，或基金管理人认定的其他可能损害现有基金份额持有人利益的情形。

9、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、5、8、9、10 项暂停申购情形时，基金管理人应当

根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或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。
- 3、本基金投资的证券、期货市场或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。
- 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赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一而基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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或部分延期赎回。

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

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

(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 10% 以上的赎回申请等情形下，基金管理人有权延期办理赎回申请。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“(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。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的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。如该持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分将作延期赎回处理。

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

### 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

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书  
募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日,基金管理人应提前 1 个工作日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值。

#### 十二、基金转换

基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务,具体内容详见 2016 年 2 月 19 日发布的《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》和其他有关基金转换公告。

##### 1、转换费率

基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

(1) 基金转换申购补差费:按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转换金额所对应的转出基金申购费低于转入基金的申购费的,补差费为转入基金的申购费和转出基金的申购费差额。转出基金金额所对应的转出基金申购费高于转入基金的申购费的,补差费为零。

(2) 转出基金赎回费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

##### 2、转换份额的计算公式

$$\text{转出金额} = \text{转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + H$$

$$\text{转入份额} = \text{转入金额} / E$$

其中:

B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的申购补差费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

H 为转出基金份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币市场基金的，则  
 $H=0$

例：投资者申请将持有的 10,000 份本基金 A 类基金份额转换为宝盈核心优势混合 A(213006)，假设转换当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0660 元，投资者持有该基金 7 个月，对应赎回费为 0.2%，申购费率为 1.5%，宝盈核心优势混合 A 的基金份额净值为 1.1630 元，申购费率为 1.5%，则投资者转换后可得到的宝盈核心优势混合 A 基金份额为：

转出金额 = 转入金额 =  $10,000 \times 1.0660 \times (1 - 0.2\%) / (1 + 0) + 0 = 10,638.68$  元

转入份额 =  $10,638.68 / 1.1630 = 9,147.62$  份

注：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

特别提示：

本公司旗下已与宝盈鸿利收益混合 A、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈核心优势混合 A、宝盈资源优选混合、宝盈睿丰创新混合 A 开通转换业务的基金，对于其下设的收取前端认购/申购费且对单笔认购/申购申请超过 500 万元（含）收取 1000 元固定认购/申购费用的基金份额，在转入宝盈鸿利收益混合 A、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈核心优势混合 A、宝盈资源优选混合或宝盈睿丰创新混合 A 时，如果单笔转入金额在 500 万（含）到 1000 万之间，在收取基金转换的申购补差费时，将直接按照转入基金的申购费收取，不再扣减申购原基金时已缴纳的 1000 元申购费。

### 3、网上直销转换费率

本基金在基金管理人网上交易平台费率及优惠情况，请以基金管理人发布的最新公告为准。

### 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。

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

#### 十四、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。

#### 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来处理。

#### 十七、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：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不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。

#### （一）大类资产配置策略

本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够成功地跟踪某类资产的上行趋势。

本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在基金合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。研判宏观形势的过程中主要考虑的因素包括：

（1）宏观经济环境

- ①季度 GDP 及其增长速度；
- ②月度工业增加值及其增长率；
- ③月度固定资产投资完成情况及增长速度；
- ④月度社会消费品零售总额及其增长速度；
- ⑤月度居民消费价格指数、工业品价格指数以及主要行业价格指数；
- ⑥月度进出口数据以及外汇储备等数据；
- ⑦货币供应量 M0、M1、M2 的增长率以及贷款增速。

（2）政策环境

- ①财政政策；
- ②货币政策；
- ③产业政策；
- ④证券市场监管政策。

（3）市场指标

- ①市场整体估值水平；
- ②市场资金的供需；
- ③市场的参与情绪；
- ④两地市场估值/资金差异性。

（二）股票投资策略

1、国家安全战略相关上市公司的界定

近年，国内外政治、军事形势错综复杂，国家安全战略成为了不可避免的话题。国防军工战略、能源战略和信息安全战略是国家安全战略的重要组成部分，是我国政策扶持、大力改革、积极引导的重要战略领域。具体而言，本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：

（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵器、核工业等；



(2) 能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保工程及服务；

(3) 信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。

未来如果由于经济与行业发展、技术进步或国家政策变更造成国家安全战略主题的覆盖范围发生变动，基金管理人有权对上述界定进行调整和修订。

## 2、子板块配置策略

按照所提供的产品与服务的不同，可以将国家安全战略相关行业细分为不同的子板块，各个子板块的行业属性与市场特征都存在差异。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对以下各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。

### (1) 盈利周期

A: 宏观经济对各板块的影响；

B: 经济周期与板块发展的相关性；

C: 板块本身的盈利周期。

### (2) 国家产业政策

A: 国家产业政策对产业的扶持态度；

B: 国家产业政策对行业的限制情况。

### (3) 行业竞争力

A: 行业的集中度及变化趋势；

B: 进出壁垒的强弱；

C: 替代产品对行业的威胁；

D: 上下游行业的景气度及议价能力。

### (4) 行业估值

本基金根据行业特点，通过横向全球估值比较和纵向行业历史数据比较，结合当前影响该行业的特定因素，如成长性、市场情绪等，确定行业合理估值。

## 3、个股精选策略

本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选

出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。

(1) 首先，使用定性分析的方法，从竞争优势、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

竞争优势分析：一是考察上市公司的市场优势，包括市场地位和市场份额、在细分市场的领先地位、品牌号召力与行业知名度以及营销渠道的优势和潜力等；二是考察上市公司的资源优势，包括物质和非物质资源，例如市场资源、技术资源等；三是考察上市公司的产品优势，包括专利保护、产品竞争力、产品创新能力和产品定价能力等优势。

市场前景分析：需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、开拓市场，进而创造利润增长的能力。

公司治理分析：公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。

(2) 其次，使用定量分析的方法，通过财务和运营数据进行企业价值评估。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

#### ①盈利能力

本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力，主要参考的指标包括净资产收益率（ROE），毛利率，净利率，EBITDA/主营业务收入等。

#### ②成长能力

本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度，主要参考的指标包括 EPS 增长率和主营业务收入增长率等。

#### ③估值水平

本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性，主要参考的指标包括市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈增长比率（PEG）、自由现金流贴现（FCFF，FCFE）和企业价值/EBITDA 等。

#### 4、存托凭证投资策略

本基金将结合宏观经济状况和发行人所处行业的景气度，关注发行人基本面情况、公司竞争优势、公司治理结构、有关信息披露情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，选择投资价值高的存托凭证进行投资，谨

慎决定存托凭证的标的选择和配置比例。

### （三）固定收益类资产投资策略

在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

#### 1、利率预期策略

通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

#### 2、信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

#### 3、套利交易策略

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下，比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破，若能提前预测并进行交易，就可进行套利或减少损失。

#### 4、可转换债券投资策略

着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

本基金将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 6、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券具有二级市场流动性差、信用风险高、票面利率高的特点。本基金将综合运用个券信用分析、收益率预期、收益率利差、收益率曲线变动、相对价值评估等策略，结合中小企业私募债券对基金资产流动性影响的分析，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别关注中小企业私募债券的信用风险分析。通过对宏观经济进行研判，根据经济周期的景气程度，合理增加或减少中小企业私募债券的整体配置比例，降低宏观经济系统性风险。本基金同时通过对发行主体所处行业、发行主体自身经营状况以及债券增信措施的分析，选择风险调整后收益最具优势的个券，保证本金安全并获得长期稳定收益。

本基金同时关注中小企业私募债券的流动性风险。在投资决策中，根据基金资产现有持仓结构、资产负债结构、基金申赎安排等，充分评估中小企业私募债券对基金资产流动性的影响，并通过分散投资等措施，提高中小企业私募债券的流动性。

### （四）金融衍生品投资策略

#### 1、权证投资策略

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具：

(1) 运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能，构建权证与标的股票的组合，主要通过波幅套利及风险对冲策略实现相对收益；

(2) 构建权证与债券的组合，利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性，形成保本投资组合；

(3) 针对不同的市场环境，构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合，形成多元化的盈利模式；

(4) 在严格风险监控的前提下，通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究，谨慎参与以杠杆放大为目标的权证投资。

## 2、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，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 股票（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不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

(4) 基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

(5) 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%；

- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (7) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (9) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (11) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (12) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (13) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (14) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (15) 本基金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；
- (16) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (17) 本基金投资流通受限证券遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字〔2006〕141 号）及相关规定执行；
- (18) 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (19) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

①本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

④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%；

⑤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规定。

（20）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（21）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（22）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；

（23）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；

（24）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

除上述第（2）、（14）、（18）、（22）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书  
法律法规或监管部门取消上述限制，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，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×65%+恒生综合指数收益率×15%+中债综合指数收益率×20%。

沪深 300 指数选样科学客观，流动性高，是目前 A 股市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。恒生综合指数涵盖香港联合交易所主板上市股份总市值约 95%，是全面的香港市场指标。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调



整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，而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，属于中高收益/风险特征的基金。

本基金除了投资于 A 股市场，还可以在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于市场联动的风险、股价波动的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通额度限制的风险、港股通可投资标的的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险（在内地市场开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、交收制度带来的基金流动性风险、港股通下对公司行为的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

## 七、基金投资组合报告（截至 2023 年 9 月 30 日）

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	313,465,796.13	80.87
	其中：股票	313,465,796.13	80.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,367,905.42	3.19
	其中：债券	12,367,905.42	3.19
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	59,550,050.75	15.36
8	其他资产	2,220,924.21	0.57
9	合计	387,604,676.51	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,662,954.38 元，占净值比为 2.29%。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	716,391.00	0.19
C	制造业	273,596,849.10	72.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.01
E	建筑业	33,967.34	0.01
F	批发和零售业	82,675.75	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,865,477.62	3.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,418,147.16	4.61
N	水利、环境和公共设施管理业	34,584.35	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	304,802,841.75	80.62

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非周期性消费品	8,400.44	0.00
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	8,654,553.94	2.29
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,662,954.38	2.29

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603283	赛腾股份	460,422	21,690,480.42	5.74
2	688036	传音控股	140,000	20,403,600.00	5.40
3	300260	新莱应材	499,940	18,942,726.60	5.01
4	301297	富乐德	710,097	15,877,768.92	4.20
5	001270	铖昌科技	190,000	15,735,800.00	4.16
6	002475	立讯精密	500,000	14,910,000.00	3.94
7	603773	沃格光电	450,000	14,062,500.00	3.72
8	600114	东睦股份	1,200,000	13,968,000.00	3.69
9	600707	彩虹股份	2,300,000	13,708,000.00	3.63
10	688103	国力股份	250,000	13,295,000.00	3.52

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,367,905.42	3.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,367,905.42	3.27

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	122,000	12,367,905.42	3.27

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### (3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### (2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	221,004.45
2	应收证券清算款	1,926,940.01
3	应收股利	114.56

4	应收利息	-
5	应收申购款	72,865.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,220,924.21

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效日为 2016 年 1 月 20 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示（截至 2023 年 9 月 30 日）：

宝盈国家安全沪港深股票 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2016 年 1 月 20 日-2016 年 12 月 31 日	11.40%	0.99%	3.42%	0.87%	7.98%	0.12%
2017 年	-15.71%	1.24%	18.67%	0.48%	-34.38%	0.76%
2018 年	-27.16%	1.68%	-18.39%	1.03%	-8.77%	0.65%
2019 年	32.60%	1.34%	24.90%	0.91%	7.70%	0.43%
2020 年	24.15%	1.90%	19.64%	1.12%	4.51%	0.78%
2021 年	64.84%	1.48%	-5.06%	0.91%	69.90%	0.57%
2022 年	-30.44%	1.55%	-16.56%	1.09%	-13.88%	0.46%
2023 年上半年	1.61%	1.32%	-0.86%	0.70%	2.47%	0.62%
2023 年第三季度	-9.39%	1.36%	-3.30%	0.75%	-6.09%	0.61%

宝盈国家安全沪港深股票 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2021 年 9 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日	7.64%	1.21%	0.79%	0.61%	6.85%	0.60%
2022 年	-30.87%	1.55%	-16.56%	1.09%	-14.31%	0.46%
2023 年上半年	1.31%	1.32%	-0.86%	0.70%	2.17%	0.62%
2023 年第三季度	-9.53%	1.36%	-3.30%	0.75%	-6.23%	0.61%

注：本基金于 2021 年 9 月 24 日起增设 C 类基金份额，对应的基金份额简称“宝盈国家安全沪港深股票 C”。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十二部分 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、权证、股指期货、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，并确定公允价格。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全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，并确定公允价格。

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



计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的估值价格确定公允价值。

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

5、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

6、本基金资产估值计算中涉及主要外币对人民币汇率的，应当以基金估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

7、对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

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

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

10、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

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书  
序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

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

#### 四、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基金份额总数计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 五、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。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基

金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

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

## 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按“三、估值方法”的第 8 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、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误、有关会计制度变化，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的相关账户的开户维护费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 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1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

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 0.60%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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、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

宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书  
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。

#### 五、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

## 第十四部分 基金收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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。本基金同一类别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。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可供分配利润有所不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### 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》的有关规定在指定媒介公告。



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

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

## 第十五部分 基金的会计和审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

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

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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、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。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、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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人决策的全部事项，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指定网站上；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。

本基金在招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，并说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。

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，并登载在指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。

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次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，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

#### （七）临时报告

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

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

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

- 16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；
- 21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 22、本基金变更基金份额类别设置；
- 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒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，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

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

#### （十一）基金投资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。

#### （十二）投资中小企业私募债券的相关公告

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

本基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （十三）投资非公开发行股票的相关公告

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指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。

#### （十四）投资股指期货的相关公告

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）等文件中披露的股指期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指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。

#### （十五）投资港股通标的股票相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露港股通标的股票的投资情况，包括报告期末本基金在香港地区证券市场的权益投资分布情况及按香港法律法规及中国证监会要求披露港股通标的股票的投资明细等内容。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过沪港股票交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （十六）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。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、基金托管人除依法在指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指定媒介披露信息，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。

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。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所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、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、风险揭示

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

#### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、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波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，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，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）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保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金财产损失。

本基金投资中小企业私募债券，其发行主体的企业管理体制和治理结构弱于普通上市公司，信息披露情况相对滞后，对企业偿债能力的评估难度高于普通上市公司，信用风险需要重点关注。本基金将通过采取控制信用等级、投资比例限

制、信用风险预算并比较等措施逐步加强对信用风险的控制。

### 3、债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

### 4、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

### 5、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现为因投资中小企业私募债券的上市流通环节受到一定限制而产生的流动性风险、基金申购、赎回现金流等因素对基金造成的流动性影响。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

### 7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### 8、合规性风险

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

### 9、人才流失风险

基金管理人主要业务人员的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

## 10、本基金特有的投资风险

### (1) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪港通机制下允许投资的香港联合交易所（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），而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。

#### 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：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；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；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；

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) 本基金基金名称包含“沪港深”字样仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

#### (3) 中小企业私募债券投资风险

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

#### (4) 股指期货投资风险

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

(5) 本基金资产投资于科创板股票，将面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、退市风险、流动性风险、投资集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。投资科创板股票存在的风险包括但不限于：

##### 1) 市场风险

科创板个股集中于新一代信息技术领域、高端装备领域、新材料领域、新能源领域、节能环保领域及生物医药领域等科技创新和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在较大的不确定性，与传统二级市场投资存在差异。科创板个股上市前五个交易日无涨跌停限制，其后涨跌幅限制为 20%，个股波动幅度较 A 股其他板块更大，将面临更高的市场风险。

##### 2) 退市风险

科创板的退市标准将比 A 股其他板块更加严格，退市时间更短，退市速度更快，退市情形更多且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节，因此上市公司面临的退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

### 3) 流动性风险

由于科创板股票的投资门槛较高，股票流动性弱于 A 股其他板块，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常交易的风险，进而带来组合整体的流动性风险。

另一方面，科创板可能采用摇号抽签方式对参与网下申购中签的账户获配股份进行一定时间的锁定，锁定期间获配的股份无法进行交易，存在流动性风险。

### 4) 投资集中度风险

科创板为新设板块，初期可投资标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，整体存在投资集中度风险。

### 5) 系统性风险

科创板上市企业主要属于科技创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险。若发生系统性风险导致股票价格同向波动，将引发基金净值波动风险。

### 6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来影响。科创板交易制度、上市条件的调整也会对基金持仓带来一定影响。

## (6) 存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），除与其他可投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还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；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；境内外法律制度、监管环境差异可能导



致的其他风险。

#### 11、其他风险

(1) 在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

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

(4) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

二、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。

#### 三、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金代销机构公开发售，基金管理人与基金代销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、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内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；基金财产清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回或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》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

1、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》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、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、赎回与转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司直接行使股东权利或通过中国证券登记结算有限责任公司对被投资港股通标的公司间接行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券、转融通;

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

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

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

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2)办理基金备案手续;

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

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

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

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

(7)依法接受基金托管人的监督;

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

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度报告、中期报告和年度报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露

及报告义务；

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任，但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利

息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户及投资所需其他账户，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、证券账户和投资所需其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规另有规定或者基金合同另有约定的，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金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、在不违背法律法规和《基金合同》的约定，以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开

基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在不影响现有基金份额持有人利益的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或销售服务费率、变更收费方式、调整基金份额类别的设置或停止现有基金份额类别的销售；
- (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) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他不需召开基金份额持有人大会情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或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 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

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 1/2（含 1/2）；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开；

（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、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的情况下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人

授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 5 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同等表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。除基金合同另有约定，转换基金运作方式、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具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 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。



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

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

### 三、基金的收益与分配

#### （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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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。本基金同一类别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。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益

分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可供分配利润有所不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

#### （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》的有关规定在指定媒介公告。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

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

### 四、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的相关账户的开户维护费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 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 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 3、基金的销售服务费

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 0.60%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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）基金税收

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

### （五）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

## 五、基金的投资

### （一）投资目标

本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票（包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及

港股通标的的股票)投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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) 投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 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的股票）投资占基金资产的比例不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家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%；

(5) 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%；

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

(7) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(9) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资

产净值的 0.5%；

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

(11) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(15) 本基金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；

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

(17) 本基金投资流通受限证券遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字〔2006〕141 号）及相关规定执行；

(18) 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(19) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

④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%；

⑤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规定。

（20）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（21）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（22）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；

（23）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；

（24）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

除上述第（2）、（14）、（18）、（22）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，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，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

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

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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产净值

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### （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指定网站披露一次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，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

## 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生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

#### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内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；基金财产清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

八、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》是约定基金合同当事人之间、基金与基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：宝盈基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 15 楼

法定代表人：严震

成立时间：2001 年 5 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字（2001）9 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字（1998）24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资

信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 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，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的国家安全战略行业、港股通标的股票的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据以下投资范围对基金的投资进行监督：

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：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不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

2、对基金投融资比例进行监督：

(1) 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不低于 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金资产的 40%，投资于国家安全战略相关行业上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

(4) 基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

(5) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

(7) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

(11) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

(14) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应

在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(15) 本基金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；

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

(17) 本基金投资流通受限证券遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字〔2006〕141号）及相关规定执行；

(18) 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(19) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

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

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

④ 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%；

⑤ 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规定。

(20) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

(21) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(22) 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。本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

(23) 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；

(24) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(14)、(18)、(22)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，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，不需要经基金份额持有人大会审议。

3、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，符合中国证监会的规定，并按法律法规予以披露。

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

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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确认并以书面形式对基金托管人发



出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当视情况暂缓或拒绝执行，及时通知基金管理人，并依照法律法规的规定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指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当及时通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

（一）在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资的所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

（三）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。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和投资所需其他账户。
- 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分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有证券、期货业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

##### （三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

##### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

5、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。

（六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行及市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的

重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

对于无法取得两份以上正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日该类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额的基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每工作日对基金财产估值，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。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后 4 位内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当任一类基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当

计价错误达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误、有关会计制度变化，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人应当免除赔偿责任。但基金管理人和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。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）基金会计核算

### 1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编

制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

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指定网站上；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。

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，并登载在指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。

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

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以电子文本或传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的

复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。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。

### （三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

## 七、适用法律与争议解决方式

### （一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，

仲裁费用由败诉方承担。

(三)除争议所涉的内容之外,本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### (一) 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行变更。变更后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

##### (二) 托管协议的终止

发生以下情况,经履行适当程序后,本托管协议应当终止:

- 1、《基金合同》终止;
- 2、本基金更换基金托管人;
- 3、本基金更换基金管理人;
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### (三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。



## 第二十一部分 基金份额持有人服务

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

### 一、注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资人办理基金帐户、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、客户服务热线服务

#### 1、自动语音服务

基金管理人为基金份额持有人提供每周7天、每天24小时的自动语音服务，客户可通过客户服务热线语音系统查询最新公告信息、基金份额净值、基金账户余额等信息。

#### 2、电话人工服务

基金管理人为基金份额持有人提供每个交易日的客户服务热线人工服务。服务时间：每个交易日 8:30—11:30，13:00-17:00。

### 三、对账服务

#### 1、自助查询

基金份额持有人可通过基金管理人的网站自动查询系统和客户服务热线语音系统，查询基金申购与赎回的交易情况、账户余额、基金产品信息等。

#### 2、电子对账单

电子对账单为月度对账单，基金管理人向留有电子邮箱的基金份额持有人提供月度电子对账单服务，电子邮箱不详及持有人主动取消服务的除外。

#### 3、纸质对账单

基金持有人需通过本基金管理人客户服务中心（400-8888-300）定制纸质对账单服务，定制纸质对账单服务后，基金管理人向年度有交易并有基金份额且电子邮箱无效的定制纸质对账单的持有人寄送，资料（含姓名及地址等）不详、留

有电子邮箱及未主动定制的投资者除外。

#### 四、资讯服务

基金份额持有人可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、理财服务资讯、热点问题等。

#### 五、交易确认通知服务

基金管理人每个交易日向客户发送上一交易日的交易确认短信和电子邮件，手机号码无效、电子邮箱不详及持有人主动取消服务的除外。

#### 六、网上交易服务

本公司网上交易平台（<http://www.byfunds.com>）、“掌上宝盈 APP”及“宝盈基金”微信公众号为基金投资人提供账户信息查询服务和网上基金电子交易服务。

#### 七、客户投诉和建议处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客户服务热线语音留言、客户服务热线人工服务、纸质信函、电子邮件、传真等方式对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

#### 八、多种购买基金收费方式选择

基金管理人为基金份额持有人提供多种收费方式购买本基金，满足基金份额持有人多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

#### 九、定期定额投资计划

基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，计划具体内容以另行公告为准。

**十、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过下列联系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。**

宝盈基金管理有限公司客户服务热线：400-8888-300（免长途话费）

宝盈基金管理有限公司网址：<http://www.byfunds.com>

宝盈基金管理有限公司客户服务电子信箱：[public@byfunds.com](mailto:public@byfunds.com)

宝盈基金管理有限公司客户服务传真：0755-83515880

## 第二十二部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露。

序号	公告名称	披露日期
1	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理变更公告	2023-03-17
2	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金经理变更公告	2023-04-01
3	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资公告	2023-04-10
4	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同	2023-08-25
5	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金托管协议	2023-08-25
6	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金更新招募说明书	2023-08-25
7	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（宝盈国家安全沪港深股票 A 份额）基金产品资料概要（更新）	2023-08-25
8	宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金（宝盈国家安全沪港深股票 C 份额）基金产品资料概要（更新）	2023-08-25

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，投资人可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

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

本基金备查文件包括：

（一）中国证监会准予宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金注册的文件；

（二）《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》；

（三）《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金托管协议》；

（四）法律意见书；

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（七）中国证监会要求的其他文件。

宝盈基金管理有限公司

2023年11月24日