

东方创新成长混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2023 年第 1 号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

东方创新成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2021年9月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方创新成长混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2021]3152号)准予募集注册。本基金基金合同于2022年4月19日正式生效。

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

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

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

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:系统性风险、非系统性风险、流动性风险、运作风险、本基金特有的风险、法律风险及其他风险等。

本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

本基金在投资中将股指期货、国债期货纳入到投资范围中,因此,可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是指由于期货与现货间的价差的波动,影响

套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险、法律风险。具体请参考招募说明书的风险揭示章节。

本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制买卖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”），会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（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）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地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）等。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。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。

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

《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。因此投资者可能面临《基金合同》自动终止的风险。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。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。

有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 3 月 31 日（财务数据未经审计），如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2023 年 4 月 19 日。

## 目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	23
五、相关服务机构.....	26
六、基金的募集与基金合同的生效.....	47
七、基金份额的申购与赎回.....	48
八、基金的投资.....	60
九、基金的业绩.....	76
十、基金的财产.....	78
十一、基金资产估值.....	79
十二、基金的收益与分配.....	86
十三、基金的费用与税收.....	88
十四、基金的会计与审计.....	91
十五、基金的信息披露.....	92
十六、侧袋机制.....	99
十七、风险揭示.....	101
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	109
十九、基金合同的内容摘要.....	111
二十、基金托管协议的内容摘要.....	134
二十一、对基金份额持有人的服务.....	147
二十二、其他应披露事项.....	149
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	152
二十四、备查文件.....	153

## 一、绪言

《东方创新成长混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)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销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)及其他有关规定以及《东方创新成长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

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

## 二、释义

在《东方创新成长混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东方创新成长混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指东方基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《东方创新成长混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方创新成长混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《东方创新成长混合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《东方创新成长混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《东方创新成长混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日

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

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

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

15、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

22、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

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

25、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、

代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

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

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

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

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

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

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

32、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、**T日**：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、**T+n日**：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、**开放日**：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日(若本基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时发布的公告为准)

37、**开放时间**：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

39、**认购**：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、**申购**：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请



## 购买基金份额的行为

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、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

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

45、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%

46、元：指人民币元

47、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

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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日各类别基金资产净值除以计算日该类基金份额总数

51、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

52、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介

53、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

54、A 类基金份额：指在投资者认购、申购时收取认购/申购费用，不从本类别

## 基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额

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

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

58、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

59、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

60、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市股票

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

### 三、基金管理人

#### 一、基金管理人基本情况

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心26层

邮政编码：100073

法定代表人：崔伟

成立时间：2004年6月11日

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

营业期限：2004年6月11日至长期

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

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80号

统一社会信用代码：911100007635106822

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

股东名称	认购股份数 (万股)	持股比例
东北证券股份有限公司	19,200	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8,100	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2,700	8.10%
天津汇智长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1,170	3.51%
天津汇远长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1,123	3.37%
天津汇聚长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1,040	3.12%
合计	33,333	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险

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

## 二、基金管理人主要人员情况

### (一) 董事会成员

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

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

李雪飞先生,董事,硕士。曾任吉林建设开发集团公司党委文书,吉林省国际信托投资公司职员,华泰证券股份有限公司长春同志街营业部交易部经理、总经理

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

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

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

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

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

刘峰先生,独立董事,大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任,海南

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

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

## (二) 监事会成员

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

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

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

## (三) 高级管理人员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，简历请参见董事介绍。

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

张科先生，副总经理，中国人民银行研究生部金融学博士。曾任甘肃银光化学工业公司中学教师，深圳发展银行蛇口支行会计、信贷业务员，深圳发展银行上海分行资金部部门负责人，平安银行北京分行副行长、资深销售总监；2019年12月

加盟本基金管理人，曾任特别助理。

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

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

许文波先生，副总经理、权益投资总监，公募投资决策委员会副主任委员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理，吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理、权益投资总监，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理。

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

郝丽琨女士，财务负责人，吉林大学社会学硕士，中国注册会计师，国际注册内审师。曾任吉林省物资贸易大厦财务部会计、吉林省证券交易中心财务部会计、东北证券股份有限公司财务部高级项目经理、稽核审计部副总经理，2010年2月加盟本基金管理人，任财务负责人。

## (四) 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
蒋茜 (先生)	2022年4月19日至 今	公司总经理助理、权益投资副总监，公募投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，13年证券从业经历。曾任GCW Consulting高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟本基金管理人，曾任权益投资部总经理、研究部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方创新成长混合型证券投资基金基金经理、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金基金经理、东方匠心优选混合型证券投资基金基金经理。

## (五) 公募投资决策委员会成员

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

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

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

蒋茜先生，简历请参见基金经理介绍。

李瑞先生，权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员。中国人民大学金融学硕士，12年证券从业经历。2011年7月加盟本基金管理人，曾任绝对收益部副总经理、权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金(于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(于2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金)基金经理、



东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金基金经理、东方高端制造混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部总经理，公募投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，15年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟本基金管理人，曾任权益研究部副总经理，权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士，固定收益投资部总经理，公募投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士，12年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本基金管理人，曾任固定收益投资部副总经理，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基

金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金(于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理,现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理、东方臻裕债券型证券投资基金基金经理。

刘长俊先生,固定收益投资部副总经理,公募投资决策委员会委员。上海财经大学金融学硕士,12年证券从业经历。曾任平安银行股份有限公司投资经理、德邦基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理。2019年7月加盟本基金管理人,现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。

盛泽先生,量化投资部总经理,资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员,华威大学经济与国际金融经济学硕士,8年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限责任公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018年7月加盟本基金管理人,曾任量化投资部总经理助理,东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理,现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深300指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

车日楠女士,固定收益研究部副总经理、公募投资决策委员会委员,北京交通大学计算数学专业硕士,8年证券从业经历。2015年7月加盟本基金管理人,曾任

固定收益研究部研究员、交易部债券交易员, 东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻善纯债债券型证券投资基金基金经理。

郑雪莹女士, 固定收益投资部副总经理、公募投资决策委员会委员, 复旦大学财务学专业硕士, 8年证券从业经历。2015年7月加盟本基金管理人, 曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员, 东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。

(六) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人职责

#### (一) 基金管理人的权利

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

##### 1、依法募集资金;

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

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

4、销售基金份额；

5、按照规定召集基金份额持有人大会；

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

7、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8、选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

10、依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

11、在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

13、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

17、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## （二）基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

- 2、办理基金备案手续；
- 3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；
- 17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资

料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **四、基金管理人的承诺**

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

(二)本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

1、将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

2、不公平地对待其管理的不同基金财产;

3、利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- 5、侵占、挪用基金财产;
- 6、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
- 7、玩忽职守,不按照规定履行职责;
- 8、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

- 1、越权或违规经营;
- 2、违反《基金合同》或托管协议;
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- 6、玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;
- 7、违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
- 8、违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
- 9、贬损同行,以抬高自己;
- 10、以不正当手段谋求业务发展;
- 11、有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- 13、其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### (四) 基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
- 2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益;
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、

基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### (一) 内部控制的原则

1、健全性原则:内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

2、有效性原则:通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。

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

4、相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

### (二) 内部控制的主要内容

#### 1、控制环境

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

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

(3)董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查,对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任;同时,通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能,避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

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

(5)建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度,严格



制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度,确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2、风险评估

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

## 3、组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次:董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导;

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

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

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

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

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

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

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

第三层次:各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

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

## 4、制度体系

制度是内部控制的指引和规范,制度缜密是内部控制体系的基础。

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

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

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

## 5、信息与沟通

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

### (三)基金管理人关于内部控制制度的声明

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

2、上述关于内部控制制度的披露真实、准确;

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

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：王小飞

联系电话：(021)6063 7103

#### (二) 主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金业务处、证券保险业务处、理财信托业务处、全球业务处、养老金业务处、新兴业务处、客户服务与业务协同处、运营管理处、跨境与外包管理处、托管应用系统支持处、内控合规处等12个职能处室，在北京、上海、合肥设有托管运营中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### (三) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品

种最齐全的商业银行之一。截至 2022 年年末,中国建设银行已托管 1270 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司(中债)“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司(上清所)“优秀托管银行”奖项、并先后荣获《亚洲银行家》颁发的 2017 年度“最佳托管系统实施奖”、2019 年度“中国年度托管业务科技实施奖”、2021 年度“中国最佳数字化资产托管银行”、以及 2020 及 2022 年度“中国年度托管银行(大型银行)”奖项。2022 年度,荣获《环球金融》“中国最佳次托管银行”,并作为唯一中资银行获得《财资》“中国最佳 QFI 托管银行”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和中国建设银行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格检查,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### (二) 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制的有效性进行指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### (三) 内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### (一) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。

利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## (二) 监督流程

1、每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2、收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### (一) 直销机构

##### 1、柜台交易

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人：崔伟

办公地址：海南省海口市龙华区滨海大道77号中环国际广场21层

联系人：李媛

电话：0898-68666597 或 0898-68666559

传真：0898-68666580

网站：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

##### 2、电子交易

投资者可以通过本基金管理人网上交易系统等办理基金的认购、申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本基金管理人网站查询。

本基金管理人网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

#### (二) 其他销售机构

销售机构	销售机构信息
中国农业银行股份有限公司	住所：北京市东城区建国门内大街69号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座 法定代表人：谷澍 客服电话：95599 网址：www.abchina.com
中国建设银行股份有限公司	住所：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心 法定代表人：田国立 客服电话：95533 网址：www.ccb.com
交通银行股份有限公司	住所：上海市浦东新区银城中路188号 办公地址：上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人：任德奇

	<p>客服电话: 95559 网址: <a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a></p>
招商银行股份有限公司	<p>注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人: 缪建民 联系人: 季平伟 客户服务电话: 95555 网址: <a href="http://www.cmbchina.com">www.cmbchina.com</a></p>
中信银行股份有限公司	<p>住所: 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 办公地址: 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 法定代表人: 朱鹤新 客服电话: 95558 网址: <a href="http://www.citicbank.com">www.citicbank.com</a></p>
兴业银行股份有限公司	<p>注册地址: 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 办公地址: 上海市银城路 167 号 法定代表人: 吕家进 联系人: 蔡宣铭 电话: 021-52629999 客服电话: 95561 网址: <a href="http://www.cib.com.cn">www.cib.com.cn</a></p>
中国民生银行股份有限公司	<p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人: 高迎欣 客服电话: 95568 网址: <a href="http://www.cmbc.com.cn">www.cmbc.com.cn</a></p>
平安银行股份有限公司	<p>注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人: 谢永林 客服电话: 95511-3 网址: <a href="http://bank.pingan.com">bank.pingan.com</a></p>
宁波银行股份有限公司同业易管家	<p>住所: 浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 210 号 19 楼 法人代表: 陆华裕 联系人: 马艺玮 电话: 021-23262715 客服电话: 95574 网址: <a href="http://www.nbcb.com.cn">www.nbcb.com.cn</a></p>
青岛银行股份有限公司	<p>住所: 青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 办公地址: 青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 法定代表人: 郭少泉</p>

	<p>联系人：陈界交  电话：0532-68629956  传真：0532-68629939  客户服务电话：96588(青岛)；400-66-96588(全国)  网址：www.qdccb.com</p>
东莞银行股份有限公司	<p>住所：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦  办公地址：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦  法定代表人：卢国锋  联系人：朱杰霞  电话：0769-27239605  客服电话：956033  网址：www.dongguanbank.cn</p>
国泰君安证券股份有限公司	<p>住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号  办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼  法定代表人：贺青  联系人：黄博铭  电话：021-38676666  传真：021-38670666  客服电话：95521  网址：www.gtja.com</p>
中信建投证券股份有限公司	<p>住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼  办公地址：北京市朝阳区朝阳门内大街188号  法定代表人：王常青  联系人：权唐  电话：010-85130588  传真：010-65182261  客服电话：400-8888-108  网址：www.csc108.com</p>
中信证券股份有限公司	<p>住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  法定代表人：张佑君  联系人：郑慧  电话：010-6083 8888  传真：010-6083 6029  客服电话：95548  网址：www.cs.ecitic.com</p>
中国银河证券股份有限公司	<p>住所：北京市西城区金融大街35号2-6层  办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦  法定代表人：陈共炎  联系人：辛国政</p>



	<p>电话: 010-80928123          传真: 010-80928123          客服电话: 4008-888-888 或 95551          网址: <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a></p>
海通证券股份有限公司	<p>住所: 上海市淮海中路 98 号          办公地址: 上海市黄浦区广东路 689 号          法定代表人: 周杰          联系人: 凌方睿          电话: 021-23219454          传真: 021-23219100          客服电话: 021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话          网址: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a></p>
长江证券股份有限公司	<p>住所: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦          办公地址: 武汉市新华路特 8 号          法定代表人: 李新华          联系人: 奚博宇          电话: 027-65799999          传真: 027-85481900          客服电话: 95579 或 4008-888-999          网址: <a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a></p>
安信证券股份有限公司	<p>住所: 深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦          办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦          法定代表人: 黄炎勋          电话: 0755-82558305          传真: 0755-82558355          客服电话: 95517          网址: <a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a></p>
渤海证券股份有限公司	<p>注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室          办公地址: 天津市南开区滨水西道 8 号          法定代表人: 安志勇          客服电话: 956066          网址: <a href="http://www.ewww.com.cn">www.ewww.com.cn</a></p>
华泰证券股份有限公司	<p>住所: 江苏省南京市江东中路 228 号          办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼          法定代表人: 周易          联系人: 郭力铭          电话: 0755-82492193          传真: 0755-82492962</p>

	<p>客服电话: 95597 网址: <a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a></p>
中信证券(山东)有限责任公司	<p>住所: 青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 办公地址: 青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法定代表人: 冯恩星 联系人: 刘晓明 电话: 0531-89606165 传真: 0532-85022605 客服电话: 95548 网址: <a href="http://sd.citics.com">sd.citics.com</a></p>
光大证券股份有限公司	<p>住所: 上海市静安区新闸路1508号 办公地址: 上海市静安区新闸路1508号3楼 法定代表人: 刘秋明 联系人: 戴巧燕 电话: 021-22169999 传真: 021-22169134 客服电话: 95525 网址: <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a></p>
东北证券股份有限公司	<p>住所: 长春市生态大街6666号 办公地址: 长春市生态大街6666号 法定代表人: 李福春 联系人: 安岩岩 电话: 0431-85096517 传真: 0431-85096795 客服电话: 95360 网址: <a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a></p>
国联证券股份有限公司	<p>注册地址: 江苏省无锡市金融一街8号国联金融大厦 办公地址: 江苏省无锡市金融一街8号国联金融大厦 法定代表人: 葛小波 联系人: 郭逸斐 联系电话: 0510-82832051 客户服务电话: 95570 传真: 0510-82831751 网址: <a href="http://www.glsc.com.cn">www.glsc.com.cn</a></p>
恒泰证券股份有限公司	<p>住所: 呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼7楼 办公地址: 呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼7楼 法定代表人: 庞介民 联系人: 熊丽 电话: 0471-4972675 客服电话: 956088 网址: <a href="http://www.cnht.com.cn">www.cnht.com.cn</a></p>
中泰证券股份有限公司	<p>住所: 济南市市中区经七路86号</p>

	<p>办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号          法定代表人：李峰          联系人：李明娟          电话：021-20315290          传真：021-20315125          客服电话：95538          网址：www.zts.com.cn</p>
西部证券股份有限公司	<p>注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室          办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室          法定代表人：徐朝晖          客户服务电话：95582          网址：www.west95582.com</p>
华龙证券股份有限公司	<p>住所：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼          办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼          法定代表人：祁建邦          联系人：范坤          电话：0931-4890208          传真：0931-4890628          客户服务电话：95368          网址：www.hlzq.com</p>
华鑫证券有限责任公司	<p>住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元          办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房          法定代表人：俞洋          联系人：杨莉娟          电话：021-54967552          传真：021-54967293          客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918          网址：www.cfsc.com.cn</p>
中国中金财富证券有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608          办公地址：广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦          法定代表人：高涛          联系人：万玉琳          联系电话：0755-82026907          客服电话：95532 或 400-600-8008          网站：www.ciccwm.com</p>
中山证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创</p>

	<p>业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层          办公地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层          法定代表人: 吴小静          联系人: 罗艺琳          电话: 0755-82943755          传真: 0755-82960582          客服电话: 95329          网址: <a href="http://www.zszq.com">www.zszq.com</a></p>
东方财富证券股份有限公司	<p>注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼          办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦          法定代表人: 戴彦          联系人: 付佳          电话: 021-23586603          客服电话: 95357          网址: <a href="http://www.18.cn">www.18.cn</a></p>
粤开证券股份有限公司	<p>住所: 广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层          办公地址: 深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层          法定代表人: 严亦斌          联系人: 彭莲          电话: 0755-83331195          客服电话: 95564          网址: <a href="http://www.lxsec.com">www.lxsec.com</a></p>
国金证券股份有限公司	<p>住所: 四川省成都市东城根上街 95 号          办公地址: 四川省成都市东城根上街 95 号          法定代表人: 冉云          联系人: 刘婧漪          电话: 028-86690057          传真: 028-86690126          客服电话: 95310          网址: <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a></p>
华宝证券股份有限公司	<p>注册地: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层          办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层          法人代表: 刘加海          电话: 4008209898          公司官网: <a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a></p>
华金证券股份有限公司	<p>注册地址: 上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室</p>

	<p>办公地址:上海市静安区天目西路128号19层1902室</p> <p>法定代表人:燕文波</p> <p>客户服务电话:956011</p> <p>网址:www.huajinsc.cn</p>
深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#</p> <p>办公地址:北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室</p> <p>法定代表人:杨懿</p> <p>联系人:张燕</p> <p>电话:010-58325388-1588</p> <p>传真:010-58325282</p> <p>客服电话:400-166-1188</p> <p>网址:8.jrj.com.cn</p>
江苏汇林保大基金销售有限公司	<p>注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号</p> <p>办公地址:南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室</p> <p>法定代表人:吴言林</p> <p>联系人:孙平</p> <p>电话:13564999938</p> <p>客服电话:025-66046166</p> <p>网址:www.huilinbd.com</p>
上海陆享基金销售有限公司	<p>注册地址:中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路888号1幢1区14032室</p> <p>办公地址:上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇广场2座16楼01、08单元</p> <p>法定代表人:栗旭</p> <p>联系人:王玉</p> <p>电话:021-53398863</p> <p>传真:021-53398801</p> <p>客服电话:400-168-1235</p> <p>网址:www.luxxfund.com</p>
腾安基金销售(深圳)有限公司	<p>注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室</p> <p>办公地址:深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层</p> <p>法定代表人:刘明军</p> <p>联系人:吴建国</p> <p>电话:0755-86013388-65061</p> <p>客服电话:95017</p> <p>网址:www.txfund.com</p>
北京度小满基金销售有限公司	<p>注册地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4</p>

	号楼1层103室 办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼 法定代表人:葛新 联系人:宋刚 电话:010-59403028 传真:010-59403027 客服电话:95055-4 网址:www.baiyingfund.com
博时财富基金销售有限公司	注册地址:深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层 办公地址:深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层 法定代表人:王德英 联系人:崔丹 电话:0755-83169999 传真:0755-83195220 客服电话:400-610-5568 网址:www.boserawealth.com
诺亚正行基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼 法定代表人:汪静波 联系人:李娟 联系电话:021-38509735 传真:021-38509777 客服电话:400-821-5399 网址:www.noah-fund.com
深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:400 678 8887 网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦 法定代表人:其实 联系人:施悦

	<p>电话：021-54509977-8151          传真：021-64385308          客服电话：400 1818 188          网址：www.1234567.com.cn</p>
上海好买基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室          办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室          法定代表人：杨文斌          联系人：张茹          电话：021-20613999          传真：021-68596916          客服电话：400 700 9665          网址：www.ehowbuy.com</p>
蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室          办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号          法定代表人：王珺          联系人：韩爱彬          客服电话：95188-8          网址：www.fund123.cn</p>
上海长量基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室          办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层          法定代表人：张跃伟          联系人：单丙焱          电话：021-20691832          传真：021-20691861          客服电话：400 820 2899          网址：www.erichfund.com</p>
浙江同花顺基金销售有限公司	<p>注册地址：杭州市文二西路1号903室          办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼          法定代表人：凌顺平          联系人：刘晓倩          电话：0571-88911818          传真：0571-88910240          客服电话：4008-773-772          网址：www.5ifund.com</p>
北京展恒基金销售股份有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层          办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层</p>

	<p>法定代表人：闫振杰  联系人：宋丽冉  电话：010-62020088  传真：010-62020355  客服电话：400 888 6661  网址：www.myfund.com</p>
上海利得基金销售有限公司	<p>注册地址：上海宝山区蕴川路5475号1033室  办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  法定代表人：李兴春  联系人：赵沛然  电话：021-50583533  传真：021-50583633  客服电话：400-921-7755  网址：www.leadfund.com.cn</p>
天津市润泽基金销售有限公司	<p>注册地址：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607  办公地址：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607  法定代表人：王正宇  联系人：孟媛媛  电话：18920017760  传真：022-23297867  客服电话：400-706-6880  网址：www.fhcfjj.com</p>
嘉实财富管理有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元  办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层  法定代表人：赵学军  联系人：余永键  电话：010-85097570  传真：010-85097308  客服电话：400-021-8850  网址：www.harvestwm.cn</p>
北京创金启富基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室  办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室  法定代表人：梁蓉  联系人：张海洋  客服电话：010-66154828  网址：www.5irich.com</p>
泛华普益基金销售有限公司	<p>注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101</p>



	<p>室          办公地址：成都市金牛区西宸龙湖国际B座12楼          法定代表人：杨远芬          联系人：史若芬          电话：020-28381666          客服电话：400-080-3388          网址：www.puyifund.com</p>
南京苏宁基金销售有限公司	<p>注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号          办公地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号          法定代表人：王峰          联系人：张云飞          电话：13016933367          客服电话：025-66996699          网址：www.snjjjin.com</p>
北京增财基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号          办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号          法定代表人：罗细安          联系人：史丽丽          电话：010-67000988          传真：010-67000988          客服电话：400-001-8811          网址：www.zcvc.com.cn</p>
通华财富(上海)基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦10层          办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦10层          法定代表人：沈丹义          联系人：陶律然          客服电话：400-101-9301          网址：www.tonghuafund.com</p>
北京中植基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室          办公地址：北京朝阳区大望路金地中心A座28层          法定代表人：武建华          联系人：丛瑞丰          联系电话：010-59313555          客服电话：400-8180-888          网址：www.zzfund.com</p>
北京汇成基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2          办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座406</p>

	<p>法定代表人：王伟刚  联系人：丁向坤  电话：010-56282140  传真：010-62680827  客服电话：400-055-5728  网址：www.hcfunds.com</p>
一路财富（北京）基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室  办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层  法定代表人：吴雪秀  联系人：吕晓歌  电话：010-88312877  传真：010-88312099  客服电话：400-001-1566  网址：www.yilucaifu.com</p>
北京钱景基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  法定代表人：赵荣春  联系人：申泽灏  电话：010-57418813  传真：010-57569671  客服电话：400 678 5095  网址：www.niuji.net</p>
海银基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元  办公地址：上海市浦东新区东方路1217号6楼  法定代表人：刘惠  联系人：毛林  电话：021-80133597  传真：021-80133413  客服电话：400-808-1016  网址：www.fundhaiyin.com</p>
济安财富（北京）基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室  办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层  联系人：李海燕  电话：010-65309516  传真：010-65330699  客服电话：400-673-7010  网址：www.jianfortune.com</p>

上海万得基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座          办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼          法定代表人：黄祎          联系人：张戈          电话：021-50712782          客服电话：400-799-1888          网址：www.520fund.com.cn</p>
上海联泰基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室          办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层          法定代表人：燕斌          联系人：陈东          电话：021-52822063          传真：021-52975270          客服电话：4000-466-788          网址：www.66zichan.com</p>
上海汇付金融服务有限公司	<p>注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼          办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼          法定代表人：金佶          联系人：陈云卉          电话：021-33323999-5611          传真：021-33323837          客服电话：400-820-2819          网址：www.chinapnr.com</p>
泰信财富基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206          办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206          法定代表人：彭浩          联系人：韩艳丽          电话：010-53579668          客服电话：400-004-8821          网址：www.taixincf.com</p>
上海基煜基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元          办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室          法定代表人：王翔          联系人：李鑫          电话：021-65370077</p>

	<p>传真: 021-55085991  客服电话: 400-820-5369  网址: <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a></p>
上海凯石财富基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  办公地址: 上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼  法定代表人: 陈继武  联系人: 葛佳蕊  联系电话: 021-63333389  传真: 021-63332523  客服电话: 4000178000  网址: <a href="http://www.lingxianfund.com">www.lingxianfund.com</a></p>
上海中正达广基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  法定代表人: 黄欣  联系人: 戴珉微  电话: 021-33768132  传真: 021-33768132*802  客服电话: 400-6767-523  网址: <a href="http://www.zzwealth.cn">www.zzwealth.cn</a></p>
北京虹点基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元  办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元  法定代表人: 胡伟  联系人: 牛亚楠  电话: 010-65951887  传真: 010-65951887  客服电话: 400-618-0707  网址: <a href="http://www.hongdianfund.com">www.hongdianfund.com</a></p>
深圳新华信通基金销售有限公司	<p>注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)  办公地址: 深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦710、711室  法定代表人: 戴媛  联系人: 原萱  客服电话: 400-000-5767  网址: <a href="http://www.xintongfund.com">www.xintongfund.com</a></p>
深圳富济基金销售有限公司	<p>注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元  办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元  法定代表人: 刘鹏宇</p>

	<p>联系人：刘勇  电话：0755-83999907-8814  传真：0755-83999926  客服电话：0755-83999907  网址：www.jinqianwo.cn</p>
上海攀赢基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室  办公地址：上海市浦东新区银城路116号大华银行大厦703室  法定代表人：郑新林  联系人：邓琦  电话：021-68889082  网址：www.pytz.cn</p>
武汉市伯嘉基金销售有限公司	<p>注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号  办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号  法定代表人：陶捷  联系人：孔繁  电话：027-87006003*8020  传真：027-87006010  客服电话：400-027-9899  网址：www.buyfunds.cn</p>
上海陆金所基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  法定代表人：郭坚  联系人：宁博宇  电话：021-20665952  传真：021-22066653  客服电话：400-821-9031  网址：www.lufunds.com</p>
珠海盈米基金销售有限公司	<p>注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491  办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203  法定代表人：肖雯  联系人：李孟军  电话：020-89629012  传真：020-89629011  客服电话：020-89629066  网址：www.yingmi.cn</p>
和耕传承基金销售有限公司	<p>注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503  办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风</p>

	<p>南路东康宁街北6号楼5楼503          法定代表人: 温丽燕          联系人: 胡静华          电话: 18638787099          客服电话: 4000555671          网址: www.hgccpb.com</p>
奕丰基金销售有限公司	<p>注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)          办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室          法定代表人: TEO WEE HOWE          联系人: 叶健          电话: 0755-89460507          传真: 0755-21674453          客服电话: 400-684-0500          网址: www.ifastps.com.cn</p>
中证金牛(北京)基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室          办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层          法定代表人: 钱昊旻          联系人: 沈晨          电话: 010-59336544          客服电话: 4008-909-998          网址: www.jnlc.com</p>
京东肯特瑞基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157          办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层          法定代表人: 王苏宁          联系人: 隋斌          传真: 010-89189566          客服电话: 95118          网址: fund.jd.com</p>
大连网金基金销售有限公司	<p>注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室          办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层          法定代表人: 樊怀东          联系人: 李鑫          电话: 0411-39027830          客服电话: 4000-899-100          网址: www.yibaijin.com</p>
中民财富基金销售(上海)有	<p>注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号7层05</p>

<p>限公司</p>	<p>单元                      办公地址:上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层                      法定代表人:弭洪军                      联系人:黄鹏                      电话:18521506916                      客服电话:400-876-5716                      网址:www.cmiwm.com</p>
<p>北京雪球基金销售有限公司</p>	<p>注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507                      办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507                      法定代表人:钟斐斐                      联系人:侯芳芳                      电话:010-61840688                      客服电话:400-159-9288                      网址:danjuanapp.com</p>
<p>深圳市前海排排网基金销售有限公司</p>	<p>注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室                      办公地址:深圳市福田区新洲南路 2008 号新洲同创汇 3 层 D303 号                      法定代表人:杨柳                      联系人:林丽/刘文婷                      联系电话:0755-82779746/18122062924                      客服电话:400-666-7388                      网址:www.simuwang.com</p>
<p>上海中欧财富基金销售有限公司</p>	<p>注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室                      办公地址:上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层                      法定代表人:许欣                      联系人:张政                      电话:18865518956                      传真:+86 21 35073616                      客服电话:400-100-2666                      网址:www.zocaifu.com</p>
<p>上海华夏财富投资管理有限公司</p>	<p>注册地址:上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室                      办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层                      法定代表人:毛淮平                      联系人:张静怡                      电话:010-88066632                      传真:010-63136184</p>

	<p>客服电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com</p>
洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司	<p>注册地址：山东省青岛市市北区龙城路31号卓越世纪中心1号楼5006户 办公地址：北京市朝阳区润世中心A座5层 法定代表人：李赛 联系人：张萌 电话：18600730680 客服电话：400-8189-598 网址：www.hongtaiwealth.com</p>
中信期货有限公司	<p>住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 法定代表人：张皓 联系人：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：0755-83201097 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com</p>
和合期货有限公司	<p>注册地址：山西省太原市迎泽区菜园东街2号 办公地址：山西省太原市迎泽区菜园东街2号 联系人：张基甲 电话：0351-7342798 传真：0351-7342538 客服电话：0351-7342798 网址：www.hhqh.com.cn</p>
中信证券华南股份有限公司	<p>住所：广州市天河区珠江西路5号501房 办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔5层 法人代表：胡伏云 客服电话：95548 网址：www.gzs.com.cn</p>
玄元保险代理有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室 法定代表人：马永谕 联系人：卢亚博 电话：137-5252-8013 客服电话：400-080-8208 网址：www.licaimofang.cn</p>
阳光人寿保险股份有限公司	<p>注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层</p>



	<p>办公地址:北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层          法定代表人:李科          客服电话:95510          网址:life.sinosig.com</p>
招商银行股份有限公司招赢通平台	<p>注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦          办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦          法定代表人:缪建民          客服电话:95555          网址:www.cmbchina.com</p>
平安银行股份有限公司行E通平台	<p>注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号          办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号          法定代表人:谢永林          客服电话:0755-82243265          网址:https://cor.etbank.com.cn/</p>
喜鹊财富基金销售有限公司	<p>注册地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室          办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室          法定代表人:陈皓          联系人:麦文楨          客服电话:400-6997-719          网址:www.xiquefund.com</p>
乾道基金销售有限公司	<p>注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室          办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室          法定代表人:王兴吉          联系人:高雪超          电话:010-62062880          传真:010-82057741          客服电话:400-088-8080          网址:www.qiandaojr.com</p>

备注:为维护投资者利益,东方基金管理股份有限公司暂停喜鹊财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金的基金开户、增开交易账户、变更交易账户、认购、申购、定期定额投资、转换、转托管入业务。已通过喜鹊财富、乾道基金持有本公司旗下基金的投资者,当前持有基金份额的赎回业务、转托管出业务不受影响,本公司恢复上述相关业务的具体时间,将另行公告。

## 二、登记机构

名称：东方基金管理股份有限公司  
住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层  
办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层  
法定代表人：崔伟  
联系人：张力苍  
电话：010-66295874  
传真：010-66578680  
网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人：韩炯  
联系人：丁媛  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
经办律师：黎明、丁媛

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层  
办公地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层  
执行事务合伙人：朱建弟、杨志国  
联系人：李永江  
电话：010-68286868  
传真：010-88210608  
经办注册会计师：李永江、高慧丽

## 六、基金的募集与基金合同的生效

一、本基金根据2021年9月29日中国证监会《关于准予东方创新成长混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2021]3152号)准予募集注册。

二、本基金类型：混合型

本基金运作方式：契约型、开放式

本基金存续期间：不定期

三、本基金募集期限为：2022年3月24日至2022年4月15日

募集份额为：358,267,042.67

有效户数：5,075户

四、本基金根据《关于东方创新成长混合型证券投资基金备案确认的函》(中国证监会证券基金机构监管部基金成立备案函[2022]426号)的批准，于2022年4月19日基金合同生效。

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 七、基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在更新的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。基金投资者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、申购和赎回的开放日及时间

#### （一）开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### （二）申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

（二）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（三）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### （一）申购和赎回的申请方式

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

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

#### （二）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。

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。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定的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、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

### (三) 申购和赎回申请的确认

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

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,而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

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,并按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

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

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

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

(四) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

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

## 六、申购费用和赎回费用

### (一) 申购费用

本基金仅对 A 类基金份额收取申购费用, 不对 C 类基金份额收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担, 不列入基金资产, 申购费用于本基金的市场推广、销售、登记等。

A 类基金份额的申购费用如下所示:

本基金对通过基金管理人直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。

养老金客户范围包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金, 包括:

- 1) 全国社会保障基金;
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金;
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划;
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
- 5) 企业年金养老金产品;
- 6) 个人税收递延型商业养老保险等产品;
- 7) 养老目标基金;
- 8) 职业年金计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人拟将其纳入养老金客户范围的, 则将按相关规定履行适当程序。

非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

1、通过直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率随申购金额的增加而递减。具体申购费率如下表所示:

申购金额 (M)	申购费率
$M < 100$ 万	0.15%
$100$ 万 $\leq M < 300$ 万	0.10%
$300$ 万 $\leq M < 500$ 万	0.08%
$M \geq 500$ 万	1000 元/笔

2、其他投资人申购本基金 A 类基金份额的申购费率随申购金额的增加而递减。具体申购费率如下表所示:

申购金额 (M)	申购费率
$M < 100$ 万	1.50%

100 万 ≤ M < 300 万	1.00%
300 万 ≤ M < 500 万	0.80%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

投资者重复申购时，需按单笔申购金额对应的费率分别计算申购费用。

## (二) 赎回费用

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率如下：

	持有时长	赎回费率	计入基金财产比例
A 类基金份额	T < 7 日	1.50%	100%
	7 日 ≤ T < 30 日	0.75%	100%
	30 日 ≤ T < 180 日	0.50%	75%
	T ≥ 180 日	0%	——
C 类基金份额	T < 7 日	1.50%	100%
	7 日 ≤ T < 30 日	0.50%	100%
	T ≥ 30 日	0%	——

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

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

(五) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定促销计划，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，在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### (一) 基金申购份额的计算：

#### 1、A 类基金份额申购份额的计算方式

##### (1) 当申购费用适用比例费率时：

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

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

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



(2) 当申购费用适用固定金额时:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

例 4: 某投资者(非养老金客户)在开放日投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额, 假设该笔申购按照 100%比例全部予以确认, 其对应申购费率为 1.50%, 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0622 元。则其可得到的 A 类基金份额为:

申购费用=100,000×1.50%/(1+1.50%)=1,477.83 元

净申购金额=100,000-1,477.83=98,522.17 元

申购份额=98,522.17/1.0622=92,752.93 份

例 5: 某养老金客户在开放日通过直销柜台投资 500 万元申购本基金 A 类基金份额, 假设该笔申购按照 100%比例全部予以确认, 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0832 元。则其可得到的 A 类基金份额为:

申购费用=1,000.00 元

净申购金额=5,000,000.00-1,000.00=4,999,000.00 元

申购份额=4,999,000/1.0832=4,615,029.54 份

2、C 类基金份额申购份额的计算方式

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

例 6: 某投资者在开放日投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额, 假设该笔申购按照 100%比例全部予以确认, 申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1200 元, 则其可得到的 C 类基金份额为:

申购份额=100,000.00/1.1200=89,285.71 份

3、上述计算中, 涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍去, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(二) 基金赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下:

赎回费用=赎回份额×T 日 A 类/C 类基金份额的基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回份额×T 日 A 类/C 类基金份额的基金份额净值-赎回费用

例 7: 假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 A 类基金份额, 持有期限 400 日, 对应的赎回费率为 0.00%, 该日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.2500 元, 则其获得

的赎回金额计算如下:

$$\text{赎回费用} = 10,000.00 \times 1.2500 \times 0\% = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,000.00 \times 1.2500 - 0.00 = 12,500.00 \text{ 元}$$

例 8: 假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 C 类基金份额, 持有期限 400 日, 对应的赎回费率为 0.00%, 该日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.2500 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

$$\text{赎回费用} = 10,000.00 \times 1.2500 \times 0\% = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,000.00 \times 1.2500 - 0.00 = 12,500.00 \text{ 元}$$

上述计算中, 涉及赎回费用的计算结果保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍去, 涉及赎回金额的计算结果以四舍五入的方法, 保留到小数点后两位, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### (三) 基金份额净值的计算

A/C 类基金份额的基金份额净值 = (A/C 类基金份额的基金资产净值总额) / (A/C 类基金份额当日发行在外的基金份额总数)

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

## 八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时, 基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

(一) 因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

(三) 证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(四) 基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

(六) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

(七) 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。

(八) 申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的情形。

(九) 港股通交易每日额度不足。

(十) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(一)、(二)、(三)、(五)、(六)、(九)、(十)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时, 基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。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及处理方式

发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

(一) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

(三) 证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(四) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(五) 发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时, 基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

(六) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

(七) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应按规定报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第(四)项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### (一) 巨额赎回的认定

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

### (二) 巨额赎回的处理方式

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

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,基金管理人应当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。

3、延期办理赎回申请:在出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的情形时,对于该基金份额持有人当日申

请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%的基金份额，基金管理人有权进行延期办理。延期办理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。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

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

### （三）巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者其他方式（包括但不限于短信、电子邮件、公告或由基金销售机构通知等方式）在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并按规定在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

（三）如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登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一个工作日的各类基金份额的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规

则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### 十三、基金的非交易过户

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

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照法律法规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、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过

中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### **十八、基金份额的质押**

在法律法规允许且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可在技术条件完善后，开展本基金的基金份额质押业务，届时无须召开基金份额持有人大会审议但须提前公告。

### **十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

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

## 八、基金的投资

### 一、投资目标

本基金将通过与创新成长企业的深入研究和分析,挖掘具有良好成长潜力的上市公司,选取符合创新和成长特征的投资标的。力争在风险可控的前提下,实现基金资产的长期、稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%),其中,投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人根据法律法规的规定或在履行适当程序后,可以对上述资产配置比例进行适当调整。

### 三、投资策略

#### (一) 资产配置策略

本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平,基于对证券市场的整体判断进而动态调整股票、



债券和货币市场工具等类别的资产配置比例及配置范围。

## (二) 股票投资策略

### 1、创新成长主题的界定

本基金界定的创新成长主题是指具有创新能力和成长能力的企业，包括但不限于：

- 1) 符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新型企业；
- 2) 属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、医药生物等高端制造和  
国家战略新兴产业；
- 3) 与包括互联网、大数据、云计算、人工智能、工业软件等技术深度融合，处于快速成长的优质企业；
- 4) 依托于技术创新、技术进步而快速发展的传统行业中优质上市公司。

本基金将主要从创新成长企业中挖掘具有良好成长潜力的上市公司，选取符合创新特征和成长特征的投资标的，构建投资标的的股票库。

**创新特征：**主要指突破传统，通过技术创新、产品创新、服务创新、商业与营销模式创新等创新手段推动产业升级，从而提升企业的竞争优势和企业价值。该类企业通常具有核心研发实力和技术、较高的行业知名度，以及良好的创新管理和企业文化，在市场竞争中具有核心优势和持续发展能力。

**成长特征：**企业所属的行业处于成长性阶段，具备良好的发展趋势；或者虽然行业相对稳定，但是企业自身的成长性较为突出。本基金将考察企业所处的产业周期、行业发展空间、行业集中度、渗透率、企业本身的增长速度等来筛选成长型企业。

具体来看投资标的包括但不限于以下特点：

- 1) 过去两年研发投入比例在可比公司中处于前 50%；
- 2) 过去两年 ROE 均位于所处行业的前 50%，或 ROE 具有较明显改善空间；
- 3) 公司未来预期净利润增速高于同期预期 GDP 增速。

本基金将综合评价上市公司过去两年的成长性，重点考察杠杆水平、收现率、市盈率、市净率、净营运周期、每股收益波动性、净资产收益率、现金充足率等指标，通过仔细分析入选个股行业属性后，筛选创新能力较强、管理优秀、具有成长性、行业地位领先的高品质上市公司作为主要投资对象，构建投资标的的股票库，进行投资组合及动态调整。

未来，本基金将根据技术进步、产业发展等变化，以及上市公司的实际经营、发展情况等实际情况调整上述创新成长主题的界定。

## 2、个股投资策略

本基金通过定性分析与定量分析相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的符合创新成长主题的股票构建投资组合。

定性分析，筛选价值公司发展潜力。本基金将结合财务数据、企业创新和成长能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 定性因素，寻找和挖掘具有较好爆发力和长期前景的创新成长企业，自下而上配置成长个股。以产业调研和深度研究为核心，采用以 GARP 策略为主导的投资方法，在投资上寻求业绩和估值匹配，重点投资于估值在合理范围内以及具备高质量成长路径的上市公司来实现股东回报。重点关注空间、竞争壁垒、成长质量和安全边际等四个维度。

定量分析，挖掘成长空间。以相对估值为主，绝对估值为辅。相对估值方法包括市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市净率（PB）、企业价值倍数（EV/EBITDA）、市销率（PS）等；绝对估值方法包括股利贴现模型（DDM）、自由现金流贴现模型（DCF）等，以此衡量股价是否处于合理的估值区间。重点关注公司未来盈利的增长潜力，并借助企业的销售增长率、主营业务利润增长率、营业利润增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率等指标来考量公司的历史成长性。从资产质量、业务增长、财务结构、利润水平、盈利构成、现金流特征等出发，挖掘具备领先优势、盈利质量较高、盈利能力较强的上市公司。

## 3、港股通标的股票投资策略

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

本基金将选择企业基本面健康、盈利前景广、业绩向上弹性较大、具有成长性且估值合理的港股纳入本基金的股票投资组合。

## 4、存托凭证投资策略

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

### （三）债券投资策略

本基金根据宏观经济运行情况、货币政策走向、金融市场运行趋势和市场利率

水平变化特点等进行分析研究,运用类别资产配置策略、久期调整策略、期限结构策略等多种积极管理策略,优选具有投资价值的个券,在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,实现基金的持续稳定增值。

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择,对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注,选择投资价值较高的个券进行投资。

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票,而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性,其中债性与可转换债券相同,即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息;而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司基本面、目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

#### (四) 资产支持证券投资策略

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

#### (五) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### (六) 国债期货的投资策略

本基金参与国债期货交易,应当根据风险管理的原则,以套期保值为目的,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。结合国债市场交易情况和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

未来,如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其

他模式,基金管理人可在履行适当程序后相应调整。随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,在履行适当程序后相应调整或更新投资策略。

#### 四、投资管理流程

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

##### (一) 研究

本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,由研究员负责,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势、货币政策和财政政策执行情况进行分析,深入研究行业景气状况、市场合理估值水平,预测利率变化趋势;深入研究其合理的投资价值;据此提出大类资产配置、行业配置、个券配置的投资建议。

##### (二) 资产配置决策

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

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

##### (三) 组合构建

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

##### (四) 交易执行

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

##### (五) 风险监控

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

理进行检讨,并及时调整。

#### (六) 风险绩效评估

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

#### (七) 组合调整

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

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

### 五、投资限制

#### (一) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1、本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%),其中,投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的80%;

2、本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等;

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

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;

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

6、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

7、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产

支持证券规模的 10%;

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

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

10、基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

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

12、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

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

14、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

15、基金参与股指期货合约或国债期货合约交易,应当遵守下列要求:

①本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

②本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;

③本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

④本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

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

16、本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

17、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;

18、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述2、9、13、14情形之外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

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

## (二) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

## 7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债总全价指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%

沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市公司股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。

上述指数均具有良好的市场代表性和市场影响力，因此根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述指数作为业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准使用的指数停止发布或更改指数名称，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与基金托管人协商一致在按照监管部门要求履行适当程序后，适当调整业绩比较基准并及时公告。



## 七、风险收益特征

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

(二) 不谋求对上市公司的控股；

(三) 有利于基金财产的安全与增值；

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

## 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 十、投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截至2023年3月31日(财务数据未经审计)。

(一) 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	144,394,004.65	91.15
	其中:股票	144,394,004.65	91.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,354,776.52	5.27
	其中:债券	8,354,776.52	5.27
	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	5,529,995.41	3.49
8	其他资产	138,570.27	0.09
9	合计	158,417,346.85	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,188,070.96	29.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,619.60	0.00
E	建筑业	8,714,616.00	5.60
F	批发和零售业	37,598.67	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	56,683,666.58	36.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,554,024.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,711.73	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	7,729,604.29	4.96
	合计	119,965,911.83	77.05

## 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(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	7,713,149.97	4.95
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	16,714,942.85	10.74
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	24,428,092.82	15.69

## (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	201,000	12,799,680.00	8.22
2	002415	海康威视	296,200	12,635,892.00	8.12
3	000032	深桑达A	263,600	8,714,616.00	5.60
4	00700	腾讯控股	23,600	7,970,503.00	5.12
5	600212	绿能慧充	932,401	7,729,604.29	4.96
6	03690	美团-W	61,400	7,713,149.97	4.95
7	300418	昆仑万维	162,500	7,601,750.00	4.88
8	002777	久远银海	261,176	7,396,504.32	4.75
9	688099	晶晨股份	82,782	6,963,621.84	4.47
10	000063	中兴通讯	185,600	6,043,136.00	3.88

## (四) 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	8,354,776.52	5.37
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	8,354,776.52	5.37

(五) 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	019688	22 国债 23	63,000	6,329,792.96	4.07
2	019679	22 国债 14	20,000	2,024,983.56	1.30
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

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

本基金所持有的深桑达 A (000032) 收到中国证监会深圳监管局对公司高管出具的监管警示函及采取出具警示函的监管措施等,违规类型为未依法履行其他职责。违规行为包括经查,公司高管秦卫明担任深圳市桑达实业股份有限公司监事期间,其配偶于 2021 年 12 月 27 日买入深桑达股票 900 股,其女儿于 2022 年 1 月 10 日卖出深桑达股票 17,400 股、2022 年 1 月 11 日买入深桑达股票 100 股。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的昆仑万维（300418）收到深圳交易所对公司出具监管函的措施等，违规类型为未依法履行其他职责。违规行为包括昆仑万维科技股份有限公司董事会：近期，公司在本所投资者关系互动平台回复 AIGC、ChatGPT 等有关提问时，称 AI 生成音乐的模型于 2022 年年中推出，目前已合作音乐、教育、汽车、游戏等领域的部分企业且产生一定收入。此外，公司还称公司合作奇点智源，将在今年内发布中国版类 ChatGPT 产品。公司股价自 2023 年 3 月以来涨幅超过 80%。2023 年 3 月 16 日及 3 月 24 日，公司在《关于对深圳证券交易所关注函回复的公告》及《关于股价异动的公告》中披露“截止目前，公司 AIGC、人工智能等业务产品尚未产生实际收入，预计对公司 2023 年财务状况不会产生较大影响。”“公司和奇点智源合作开发中国版类 ChatGPT，预计今年内将发布中国版类 ChatGPT，并且会将代码开源。中国版类 ChatGPT 的知识产权归奇点智源所有，后续公司享有中国版类 ChatGPT 商业化产生的净利润的 50%，但后续能否顺利实现商业化存在较大的不确定性。”在 ChatGPT 及相关概念受投资者广泛关注的背景下，公司通过互动易回复投资者咨询时未能客观、完整地介绍和反映公司相关业务的实际情况、对公司业绩的影响及充分提示相关风险。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的中兴通讯（000063）收到中国证监会深圳监管局对公司高管出具监管函的措施等，违规类型为未依法履行其他职责。违规行为包括经查，公司高管李妙娜担任中兴通讯监事期间，其母亲于 2022 年 9 月 14 日至 2022 年 9 月 16 日期间累计买入中兴通讯股票 2,000 股，累计卖出中兴通讯股票 2,000 股。上述行为违反了《中华人民共和国证券法》第四十四条第一款和第二款的规定，构成短线交易。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的晶晨股份（688099）收到中国证监会广东监管局对公司高管出具警告、公开批评、公开处罚等措施，违规类型为未依法履行其他职责。违规行为包括因公司高管王成先生原任职的公司收购项目中未按规定履行报告、公告义务，未按规定履行发出收购要约义务等行为。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

本基金投资深桑达 A 主要基于以下原因：公司是 CEC 集团国资云及数据要素业务核心平台，国资云及数据要素有望驱动公司业绩超预期增长。

本基金投资昆仑万维主要基于以下原因：公司通过孵化、并购等形成五大业务板块，分别为海外信息分发与元宇宙平台、海外社交娱乐平台、全球移动游戏平台、休闲娱乐平台与科技股权投资平台。看好公司海外业务中 Opera 与 StarX，以及游戏业务中 ArkGames 加快自研游戏推进，或将成为公司新的增长点。

本基金投资中兴通讯主要基于以下原因：公司是网络设备龙头，未来以服务器为代表的第二曲线业务驱动公司业绩快速增长，公司价值有望重估。

本基金投资晶晨股份主要基于以下原因：公司是多媒体 APSoC 龙头，拥有 S/T/AI/W/V 五大系列 SOC 芯片，分别对应智能机顶盒、智能显示终端、智能音视频、WiFi 蓝牙、车载信息娱乐系统五大领域，看好公司 2023 年业务反转。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 2、基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

## 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	111,508.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	27,061.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	138,570.27

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、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。

### 1、基金的净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 东方创新成长混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022.04.19-2022.12.31	-9.51%	1.55%	-4.49%	0.99%	-5.02%	0.56%
2023.01.01-2023.03.31	14.49%	1.39%	3.37%	0.69%	11.12%	0.70%

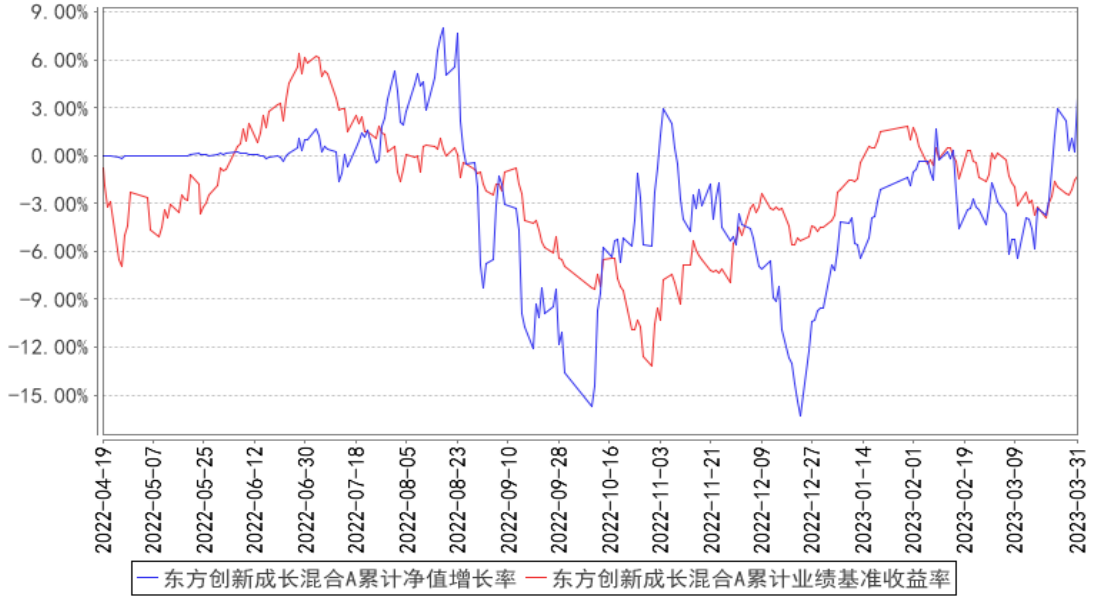
#### 东方创新成长混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022.04.19-2022.12.31	-9.89%	1.55%	-4.49%	0.99%	-5.40%	0.56%
2023.01.01-2023.03.31	14.32%	1.39%	3.37%	0.69%	10.95%	0.70%

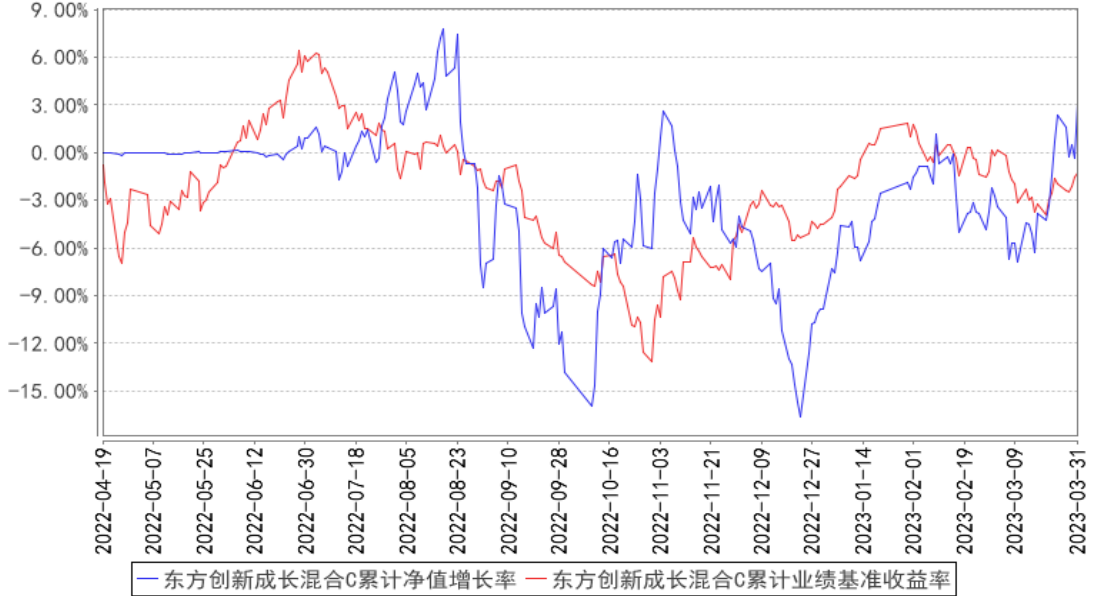
### 2、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方创新成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方创新成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于2022年04月19日生效，建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## 十、基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、债券托管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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十一、基金资产估值

### 一、估值目的

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

### 二、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、银行存款本息、同业存单、股指期货合约、国债期货合约、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 四、估值原则

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

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

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

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

切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

## 五、估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；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的，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，以交易所每日收盘价作为估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，以最近交易日债券收盘价作为估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

3、对全国银行间市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种, 在发行利率与二级市场利率不存在明显差异, 未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下, 按成本估值。

4、本基金存入银行或其他金融机构的各项款项以本金列示, 按协议或约定利率逐日确认利息收入。

5、本基金投资同业存单, 采用估值日第三方估值机构提供的估值净价进行估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 按成本估值。

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

7、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的, 按证券所处的市场分别估值。

8、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的, 采用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进行计算。

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

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、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。

11、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

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

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

根据有关法律法规,基金净值信息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,按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 六、估值程序

(一) 各类基金份额的基金份额净值是按照每个估值日闭市后,该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制,具体可参见基金管理人届时的相关公告。国家法律法规及基金合同另有规定的,从其规定。

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

(二) 基金管理人应每个估值日对基金资产估值,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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后,将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按约定对外公布。

## 七、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

### (一) 估值错误类型

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

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

## (二) 估值错误处理原则

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

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

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

4、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## (三) 估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

2、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

3、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和

赔偿损失;

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

(四)基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 八、暂停估值的情形

(一)基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(二)因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

(四)法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 九、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人根据基金合同的约定对基金净值予以公布。

## 十、特殊情形的处理

(一)基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(二)由于不可抗力,或由于证券/期货交易所、登记结算公司等机构发送的数



据错误等原因,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而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

### **十一、实施侧袋机制期间的基金资产估值**

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

## 十二、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

(一) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(二) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按红利发放日的各类基金份额净值转成相应类别的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

(三) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额的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;

(四) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;同一类别每一基金份额享有同等分配权;

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

(六) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人可在法律法

规允许的前提下与基金托管人协商一致后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### **四、收益分配方案**

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

#### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

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

#### **七、实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 十三、基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- (一) 基金管理人的管理费;
- (二) 基金托管人的托管费;
- (三) C类基金份额的销售服务费;
- (四) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- (五) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
- (六) 基金份额持有人大会费用;
- (七) 基金的证券/期货等交易、结算费用;
- (八) 基金的银行汇划费用;
- (九) 基金的开户费用、账户维护费用;
- (十) 因投资港股通标的股票而产生的各项费用;
- (十一) 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

#### (一) 基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### (二) 基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### (三) C类基金份额销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费;本基金C类基金份额的销售服务费每日按前一日C类基金资产净值的0.60%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

本基金C类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第(四)一(十一)项费用,根据有关法律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:

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

### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应

待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。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。

## 十四、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

(一) 基金管理人为本基金的基金会计责任方;

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

(三) 基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

(四) 会计制度执行国家有关会计制度;

(五) 本基金独立建账、独立核算;

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

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

### 二、基金的年度审计

(一) 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

(二) 会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。

(三) 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 十五、基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2、对证券投资业绩进行预测;
- 3、违规承诺收益或者承担损失;
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 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者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上；将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、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规定媒介上。

（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规定媒介上登载《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规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

#### (五) 基金份额申购、赎回价格

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

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

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内, 编制完成基金年度报告, 将年度报告登载在规定网站上, 并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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。

#### (七) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、《基金合同》终止、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、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、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、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、本基金连续 30、40、45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；
- 24、调整基金份额类别的设置；
- 25、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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十一）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度报告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）基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险

指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十三）基金投资国债期货的信息披露

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

#### （十四）基金投资流通受限证券的信息披露

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

#### （十五）基金投资港股通标的股票的信息披露

若本基金参与港股通交易，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

#### （十六）实施侧袋机制期间的信息披露

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

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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊披露本基金信息。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规定媒介上披露信息外, 还可以根据需要在其他公共媒介披露信息, 但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息, 并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

#### **七、暂停或延迟披露基金信息的情形**

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、不可抗力;
- 2、发生暂停估值的情形;
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

#### **八、信息披露文件的存放与查阅**

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

## 十六、侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告,并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

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

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

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的,基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

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

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后,基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则,采取将特定资产予以处置变现等方式,及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

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

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后,基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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

##### 2、基金净值信息

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

##### 3、定期报告



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

## 十七、风险揭示

本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,将面临港股通机制下因

投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金所面临的风险主要包括以下部分：

### 一、系统性风险

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

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

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

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

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

### 二、非系统性风险

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

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

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

### 三、流动性风险

流动性风险主要包括以下两个方面：一方面是指在市场流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是

指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

### （一）本基金申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

除上述申购、赎回安排外，本基金拟就大额申购及巨额赎回两个方面做好预防基金流动性风险的准备措施。

#### 1、大额申购

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，本基金管理人将采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益；

若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，本基金管理人将拒绝超出比例的申购申请。

#### 2、巨额赎回

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

另外，在出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%的基金份额，基金管理人有权进行延期办理。延期办理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。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的情形及处理方式”中“全额赎回”或“部分延期赎回”的

约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是,如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

## (二) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

上述资产均存在规范的交易场所,运作方式规范透明,从市场历史数据来看,具备良好的流动性。本基金针对各类投资标的的流动性特点进行分散投资,根据法律法规及本基金基金合同的约定,及时调整7个工作日内可变现资产的配置情况,确保投资资产处于较高的流动性。当基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值不足支付当日净赎回申请所需资金时,本基金管理人有权按比例拒绝基金份额持有人的赎回申请。

## (三) 巨额赎回下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时,基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施:

- 1、延期办理巨额赎回申请;
- 2、暂停接受赎回申请;
- 3、延缓支付赎回款项;
- 4、摆动定价;
- 5、实施侧袋机制;
- 6、收取短期赎回费;
- 7、中国证监会认定的其他措施。

## (四) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响:

基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:

1、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购/赎回申请。在此情形下，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额或延迟取得赎回款项的风险。

2、在出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%的基金份额，基金管理人有权进行延期办理。具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的情形及处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

3、持有人提出赎回申请时，本基金对持有期少于 7 日的投资者收取 1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

5、侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考

虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 四、运作风险

①管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于基金管理人内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

②交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

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

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

#### 五、本基金特有的风险

1、《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。因此投资者可能面临《基金合同》自动终止的风险。

2、本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（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）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地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）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。

3、本基金在投资中将股指期货、国债期货纳入到投资范围中，因此，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此

类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

4、本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

①信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

②利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

③流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

④提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

⑤操作风险：基金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、交易错误、IT 系统故障等风险。

⑥法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

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

## 六、法律风险

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

## 七、其他风险

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

根据交易所就资金前端额度控制的相关要求，基金管理人（交易参与人）按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度，并与

---

基金托管人(结算参与人)明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端额度控制的规定,从而可能存在影响本基金财产收益的风险。



## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

(一) 变更基金合同涉及法律法规规定或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。

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

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

### 三、基金财产的清算

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

(二) 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(四) 基金财产清算程序:

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

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 十九、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (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、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

(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

资料不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金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者的利益；

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、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、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当

的措施:

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限;

(12) 建立并保存基金份额持有人名册;

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成, 基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的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、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》, 但基金合同另有约定的除外;



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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率和销售服务费率或变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- (5) 停止现有基金份额类别的销售、增加新的基金份额类别或者调整基金份额类别设置规则等;
- (6) 调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资计划等业务的规则;
- (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其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

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

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

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式;
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

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

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

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

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

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

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

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

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

#### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权

的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### (七) 计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

#### (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### (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,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按红利发放日的各类基金份额净值转成相应类别的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额的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,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;同一类别每一基金份额享有同等分配权;

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

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人可在法律法规允许的前提下与基金托管人协商一致后酌情调整以上基金收益分配原则,此项调整不需要召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### (四) 收益分配方案

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

#### (五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### (六) 基金收益分配中发生的费用

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

#### (七) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的,侧袋账户不进行收益分配,详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、C类基金份额的销售服务费;
- 4、《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、诉讼费和仲裁费;
- 6、基金份额持有人大会费用;

- 7、基金的证券/期货等交易、结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、C类基金份额销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费；本基金C类基金份额的销售服务费每日按前一日C类基金资产净值的0.60%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 类基金份额前一日基金资产净值

本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。

(五) 基金税收

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

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

(一) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允

许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%),其中,投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人根据法律法规的规定或在履行适当程序后,可以对上述资产配置比例进行适当调整。

## (二) 投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%),其中,投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的80%;

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等;

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

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;

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

(6) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

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

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

(10) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

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

(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 30%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

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

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

(15) 基金参与股指期货合约或国债期货合约交易, 应当遵守下列要求:

① 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%, 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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

② 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

④本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

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

（16）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（17）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；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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

## 六、基金净值信息的计算方法和公告方式

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

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

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

## 七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### (一) 《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

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

3、《基金合同》约定的其他情形;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金财产;

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

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

### (四) 清算费用

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

### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按各类基金份额持有人持有的该类



基金份额比例进行分配。

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

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

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：东方基金管理股份有限公司

注册地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立日期：2004 年 6 月 11 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

存续期间：2004 年 6 月 11 日至长期

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

#### (二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政

府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），其中，投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人根据法律法规的规定或在履行适当程序后，可以对上述资产配置比例进行适当调整。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1. 本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票

的比例不超过股票资产的 50%)，其中，投资于本基金界定的创新成长主题相关的证券资产的比例不低于非现金资产的 80%；

2. 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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、存出保证金和应收申购款等；

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

4. 本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

6. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

8. 本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

10. 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

12. 本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且在本基金托管人处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%；完全按照有关指数的构成比例进行

证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

14.基金参与股指期货合约或国债期货合约交易，应当遵守下列要求：

①本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

④本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

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约定；

15.本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

16.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；

17.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述2、9、13情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

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

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对本托管协议第十五条第(九)款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

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

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

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。若管理人未提供交易对手名单,则视同可与所有交易对手进行交易。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易

方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

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

1.本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

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

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

本基金投资流通受限证券,不得预付任何形式的保证金。

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

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基

金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

(1)中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2)非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

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

(4)基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

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

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

5.基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

(1)本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

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

(3)有关比例限制的执行情况。

(4)信息披露情况。

6.相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的,从其规定。

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

(七)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核



查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(八)基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九)若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、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的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管

理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 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。
- 3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。

5.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。

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

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

##### (二)基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将

属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### (三) 基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 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任何其他银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

5. 管理人应于基金合同终止后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转,在确保后续不再发生款项进出后的10个工作日内向托管人发出销户申请。

### (四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付,待本基金启始运营后,基金管理人可向基金托管人发送划款指令,将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法

人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5. 账户注销时,由基金管理人依据中国证券登记结算有限责任公司相关规定,委托有交易关系的证券公司负责办理。销户完成后,基金管理人需将相关证明提供至基金托管人。账户注销期间如需基金托管人提供配合的,基金托管人应予以配合。

6. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### (五) 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;基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户,持有人账户和资金结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (六) 其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让,按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外,基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

## 五、基金资产净值的计算及复核程序

### (一) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。各类基金份额的基金份额净值是按照每个估值日闭市后,该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制,具体可参见基金管理人届时的相关公告。国家法律法规及基金合同另有规定的,从其规定。

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

### (二) 复核程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值,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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后,将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按约定对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册,保存期不少于法律法规规定的最低年限。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其真实性、准确性和完整性。基

金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

## 七、托管协议的变更与终止

### (一) 托管协议的变更程序

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

### (二) 托管协议终止的情形

- 1.《基金合同》终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

## 八、争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### 一、开户确认

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

### 二、资料发送

#### 1、基金投资人对账单

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

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

#### 2、其他资料

基金管理人将根据基金份额持有人的定制要求和相应的客户类别,寄送公司期刊及各类研究报告,动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### 三、呼叫中心服务

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

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

东方基金呼叫中心传真:010-66578700

#### 四、短信服务

若投资者准确完整地预留了手机号码(小灵通用户除外),可获得免费手机短信服务,包括交易短信、短信对账单、净值短信、产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆基金管理人网站添加后获得此项服务。若因网络、数据传输等原因导致短信内容有误,具体内容以公司信息为准。

#### 五、网上交易业务

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

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

#### 六、网上查询服务

通过基金管理人网站,客户还可获得如下服务:

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

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

#### 七、客户投诉受理服务

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

八、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,请通过上述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。



## 二十二、其他应披露事项

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

二、基金管理人和基金份额持有人应遵守《业务规则》等有关规定（包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充）。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成决议。

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

四、自本基金基金合同生效日2022年4月19日到本次《招募说明书(更新)》截止日2023年4月19日之间的信息披露事项如下：

公告名称	公告日期
东方创新成长混合型证券投资基金基金合同生效公告	2022-04-20
东方创新成长混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	2022-05-21
关于增加洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	2022-05-27
关于增加大连网金基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	2022-05-30
关于增加安信证券股份有限公司等三家机构为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告	2022-06-01
东方基金直销中心办公地址及联系方式变更公告	2022-06-22
关于增加上海陆享基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	2022-07-05
东方基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2022-07-06
关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基	2022-07-06

金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	
2022年二季度报告	2022-07-20
关于旗下部分基金参与嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	2022-07-21
关于东方基金旗下部分基金在诺亚正行基金销售有限公司开通转换业务的公告	2022-07-25
东方基金管理股份有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2022-07-26
关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告	2022-08-29
2022年中期报告	2022-08-31
关于增加华宝证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2022-09-27
关于增加平安银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2022-09-30
关于增加博时财富基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	2022-10-22
2022年三季度报告	2022-10-26
关于增加上海攀赢基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	2022-12-15
2022年四季度报告	2023-01-19
关于增加和合期货有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2023-02-10
关于增加招商银行股份有限公司为东方创新成长混合型证券投资基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2023-02-21
关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2023-03-02
关于增加青岛银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机	2023-03-03

构同时开通定投及转换业务的公告	
关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	2023-03-09
2022年年度报告	2023-03-29

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

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

## 二十四、备查文件

- 一、中国证监会准予东方创新成长混合型证券投资基金注册的文件
- 二、《东方创新成长混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东方创新成长混合型证券投资基金托管协议》
- 四、关于申请募集注册东方创新成长混合型证券投资基金的法律意见
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

东方基金管理股份有限公司

2023年6月