中欧基金管理有限公司

中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金
更新招募说明书

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二六年七月

重要提示

2016 年 8 月 31 日中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，主要变更了本基金的投资范围和费率，并基于上述变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金的其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2016 年 9 月 5 日起，原《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且修订后的《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

基金管理人保证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，投资人在申购本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易量不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险，以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险，可能影响基金资产变现能力，造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则，审慎参与中小企业私募债券的投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程

中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

除非另有说明，本《招募说明书》本次更新内容及截止日期如下：

序号	更新内容	截至日期
1	基金管理人概况及主要人员信息	2026 年 7 月 23 日
2	基金经理信息	2026 年 7 月 7 日
3	财务数据（未经审计）和净值表现	参见相关章节
4	业绩比较基准相关信息	2026 年 7 月 27 日
5	其他文字内容	2026 年 4 月 30 日

目 录

第一部分 绪言 5
第二部分 释义 6
第三部分 基金管理人 11
第四部分 基金托管人 22
第五部分 相关服务机构 26
第六部分 基金的历史沿革与存续 28
第七部分 基金份额的申购与赎回 30
第八部分 基金的投资 41
第九部分 基金的业绩 57
第十部分 基金的财产 59
第十一部分 基金资产的估值 60
第十二部分 基金的收益与分配 66
第十三部分 基金的费用与税收 68
第十四部分 基金的会计与审计 70
第十五部分 基金的信息披露 71
第十六部分 风险揭示 78
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 81
第十八部分 基金合同内容摘要 83
第十九部分 基金托管协议的内容摘要 84
第二十部分 对基金份额持有人的服务 85
第二十一部分 其他应披露事项 86
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 87
第二十三部分 备查文件 88
附件一 基金合同内容摘要 89
附件二 基金托管协议内容摘要 105

第一部分　绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规及《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

第二部分　释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金

2、基金管理人：指中欧基金管理有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、《基金合同》或基金合同：指《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告：指《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 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，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》修改《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 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

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，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

12、《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

13、《流动性管理规定》：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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者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可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

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

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中欧基金管理有

限公司或接受中欧基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

28、基金合同生效日：指修订后的《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日，原《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效

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

30、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、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

33、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

34、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

35、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

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

37、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

38、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

39、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

40、基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

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

42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

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

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

45、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

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：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

53、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

54、基金产品资料概要：指《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。

第三部分　基金管理人

一、基金管理人概况

1、名称：中欧基金管理有限公司

2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

4、法定代表人：窦玉明

5、组织形式：有限责任公司

6、设立日期：2006 年 7 月 19 日

7、批准设立机关：中国证监会

8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号

9、存续期限：持续经营

10、电话：021-68609600

11、传真：021-68609601

12、联系人：马云歌

13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

14、注册资本：2.20 亿元人民币

15、股权结构：

序号	股东名称	注册资本 （人民币/万元）	比例
1	WP Asia Pacific Asset Management LLC 华平亚太资产管理有限公司	5,126	23.3000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	窦玉明	3,960	18.0000%
4	上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)	2,083.1816	9.4690%
5	上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)	555.0000	2.5227%
6	刘建平	1,094.5000	4.9750%

7	周蔚文	842.7580	3.8307%
8	许欣	746.8045	3.3946%
9	卢纯青	495.7760	2.2535%
10	于岚	394.5319	1.7933%
11	葛兰	370	1.6818%
12	王培	365	1.6591%
13	于洁	230.8340	1.0492%
14	郑焰	220	1%
15	方伊	171.0180	0.7774%
16	卞玺云	168.4660	0.7658%
17	曲径	130	0.5909%
18	刘伟伟	130	0.5909%
19	郑苏丹	119.7580	0.5444%
20	袁维德	109	0.4955%
21	蓝小康	100	0.4545%
22	许文星	73	0.3318%
23	黎忆海	69.3720	0.3153%
24	殷姿	45	0.2045%
共 计		**22,000**	**100%**

注：因四舍五入,股权比例加总存在尾差。

二、主要人员情况

1．基金管理人董事会成员

窦玉明先生，中国籍。清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA。现任中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立公益基金会理事，中邮理财有限责任公司独立董事，上海市浦东新区陆家嘴金融城商会会长。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理、董事。

周朗朗先生，中国香港籍。加拿大西安大略大学本科，清华大学高级管理人员工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司副董事长，美国华平投资集团中国

区联席总裁、中国金融及企业服务行业和工业科技投资行业主管合伙人、董事总经理，河南中原消费金融股份有限公司董事。历任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）银行和花旗银行（香港）投资银行部分析师。

苏国栋先生，中国籍。美国德克萨斯大学阿灵顿分校高级管理人员工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司董事，国都景瑞投资（北京）有限公司董事、代总经理。历任中国人民保险公司分支机构负责人，海通证券深圳投资银行总部高级投行经理，中国彩棉集团股份有限公司董事、总经济师，国都证券股份有限公司投资银行董事副总经理，国都景瑞投资（北京）有限公司业务总监、副总经理。

刘建平先生，中国籍。北京大学法学学士、法学硕士，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理兼首席信息官，中欧基金国际有限公司董事长，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。历任北京大学教师，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

樊扬先生，中国籍。澳大利亚麦考里大学经济学硕士，清华大学高级工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任 CPPIB PE Investment Asia Limited 董事总经理，Citron PE Investment (Hong Kong) 2016 Limited 董事总经理，中信产业基金管理公司投资总监，国际金融公司中国代表处投资官员、高级投资官员，北京鹏联投资顾问有限公司副总裁，德勤咨询（上海）有限公司北京分公司高级咨询顾问、经理，荷兰银行北京分行信贷经理，渣打银行天津分行信贷助理。

钟炜先生，中国籍。毕业于西北政法大学本科。现任中欧基金管理有限公司独立董事，北京市康达（广州）律师事务所律师。历任北京市康达（广州）律师事务所广州分所主任，北京市康达律师事务所律师、高级合伙人，陕西省洋县人民法院副院长。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学国际金融系世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事，上海财经大学金融学教授、上海财经大学青岛财富管理研究院名誉院长，中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事，上海袅之文学艺术创作有限公司执行董事，江苏昆山农村商业银行股份有限公司独立董事。历任上海财经大学金融系副主任，上海财经大学财务金

融学院副院长，上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院直属党支部书记兼副院长。

2．基金管理人监事会成员

顾飞先生，中国籍。中国社会科学院工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司监事会主席，国都创业投资有限责任公司副总经理。历任北京锦润投资管理有限公司客户部总经理，重庆国投财富投资管理有限公司大客户部副总经理，重庆国际信托股份有限公司信托经理，天风证券股份有限公司交易员，银河德睿资本管理有限公司投资经理。

江知玥女士，中国籍。剑桥大学地产金融专业硕士。现任中欧基金管理有限公司监事，美国华平投资集团股权投资部投资董事。历任美国银行公司全球市场部经理，上海维信荟智金融科技有限公司战略规划经理，瑞士信贷（香港）有限责任公司投资银行部分析师。

李琛女士，中国籍。同济大学计算机及应用专业学士。现任中欧基金管理有限公司监事、理财规划总监。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

刘京鹏先生，中国籍。复旦大学金融学硕士。现任中欧基金管理有限公司监事、战略规划及业务发展总监。历任华宸未来基金管理有限公司产品与金融工程部产品经理。

3．基金管理人高级管理人员

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

许欣先生，中欧基金管理有限公司副总经理，中欧基金国际有限公司董事，中国籍。中国人民大学金融学硕士，中欧国际工商学院 EMBA。历任华安基金管理有限公司北京分公司投资顾问，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司副总经理、权益投决会委员、投资总监、基金经理，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中欧盛世资产管理（上海）有

限公司董事，兴盛天成投资管理（南平）有限公司董事，中欧私募基金管理（上海）有限公司董事，中欧基金国际有限公司首席稽核官，中国籍。清华大学五道口金融学院 EMBA。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

于岚女士，中欧基金管理有限公司财务负责人/人力资源总监，上海中欧财富基金销售有限公司监事，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事，中欧私募基金管理（上海）有限公司董事，中国籍。上海财经大学金融学硕士、上海交通大学高级金融学院 EMBA。历任上海证券信息有限公司总裁行政助理，中欧基金管理有限公司总经理助理、运营副总监、行政部总监。

4．本基金基金经理

（1）现任基金经理

姓名	华李成	性别	男
国籍	中国	最高学历、学位	研究生、硕士
其他公司历任	浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资经理		
本公司历任	投资经理助理、投资经理、多资产公募组组长		
本公司现任	多资产投决会委员/多资产多元配置组组长/基金经理		
本基金经理所管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金	2018 年 03 月 29 日	
2	中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金	2018 年 10 月 17 日	2020 年 04 月 30 日
3	中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）	2019 年 12 月 04 日	2021 年 10 月 21 日
4	中欧睿尚定期开放混	2020 年 04 月	2021 年 12 月

	合型发起式证券投资基金	30 日	17 日
5	中欧可转债债券型证券投资基金	2020 年 05 月 06 日	2021 年 11 月 03 日
6	中欧添益一年持有期混合型证券投资基金	2020 年 10 月 22 日	2024 年 05 月 07 日
7	中欧瑾利混合型证券投资基金	2020 年 12 月 30 日	
8	中欧融益稳健一年持有期混合型证券投资基金	2021 年 03 月 04 日	
9	中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金	2021 年 05 月 13 日	2022 年 06 月 06 日
10	中欧精益稳健一年持有期混合型证券投资基金	2021 年 06 月 10 日	
11	中欧丰利债券型证券投资基金	2021 年 12 月 09 日	
12	中欧融享增益一年持有期混合型证券投资基金	2022 年 01 月 25 日	2024 年 07 月 30 日
13	中欧鑫享鼎益一年持有期混合型证券投资基金	2022 年 03 月 08 日	
14	中欧汇利债券型证券投资基金	2023 年 08 月 23 日	
15	中欧磐固债券型证券投资基金	2023 年 11 月 02 日	

16	中欧多利债券型证券投资基金	2025 年 01 月 23 日	

（2）历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
朱晨杰	2017 年 04 月 07 日	2018 年 08 月 21 日
张跃鹏	2015 年 11 月 27 日	2020 年 07 月 09 日
刘德元	2015 年 11 月 27 日	2017 年 06 月 27 日
吴启权	2015 年 11 月 17 日	2016 年 12 月 22 日
孙甜	2015 年 11 月 17 日	2016 年 12 月 22 日

5．基金管理人投资决策委员会成员

权益投资决策委员会：葛兰、卢纯青、蓝小康、任飞、王培、周蔚文担任委员会委员，周蔚文担任委员会主席；

固收投资决策委员会：陈凯杨、邓欣雨、黄海峰、雷志强、吕修磊、邵凯、王申、闫沛贤担任委员会委员，邵凯担任委员会主席；

多资产投资决策委员会：黄华、华李成、吕修磊、桑磊、许文星、向蔼旭担任委员会委员，黄华担任委员会主席；

量化投资决策委员会：曲径、宋婷、宋巍巍、王健担任委员会委员，曲径担任委员会主席。

6．上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法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申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

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

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

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3)利用基金财产或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规定禁止的其他行为。

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

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

6、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，不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

1、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，维护内控制度的有效执行。

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

（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。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

（3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和

执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

（4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

（5）风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

（6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项的检查和反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

（7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

3、内部控制的措施

（1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的

应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

4、基金管理人关于内部控制制度的声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行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；本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：Bank of Communications Co., Ltd.

法定代表人：任德奇

住　　所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：883.64亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：方圆

电　话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续17年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强，营业收入排名第168位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第9位。

截至2026年3月31日，交通银行资产总额为人民币16.27万亿元。2026年一季度交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币261.62亿元。

交通银行总行设资产托管部/资产托管业务发展中心（下文简称“托管部/托管发展中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生2020年1月起任交通银行董事长，2018年8月起任交通银行执行董事。曾任交通银行副董事长、执行董事、行长。曾任中国银行执行董事、副行长，期间曾兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，中国银行上海人民币交易业务总部总裁。曾任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

张宝江先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

张先生2024年8月起任交通银行副董事长、执行董事，2024年6月起任交通银行行长；曾任中国农业发展银行副行长，安徽省分行行长，总行办公室主任，陕西省分行副行长，总行政策研究室副主任（主持工作）、办公室副主任、研究室副主任等职务。张先生1998年于中央党校研究生院获经济学硕士学位，2004年于中央党校研究生院获经济学博士学位。

孟羽先生，资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

孟先生2025年9月起任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。曾任交通银行香港分行行政总裁，交通银行（香港）有限公司副董事长、执行董事、行政总裁，交银国际控股有限公司执行董事、首席执行官，广东省分行副行长，营业部副总经理，深圳分行国际业务部高级经理。曾在中国工商银行十堰分行工作。孟先生1999年于复旦大学获工商管理硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2026年3月31日，交通银行共托管证券投资基金933只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转国有资本充实社保基金、养老保障管理产品、企业年金基金、职业年金基金、企业年金养老金产品、商业养老金产品、期货公司资产管理计划、QFI证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE、QDLP和QFLP、债券“南向通”等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部

管理，托管部/托管发展中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1.合法性原则：托管部/托管发展中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2.全面性原则：托管部/托管发展中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3.独立性原则：托管部/托管发展中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4.制衡性原则：托管部/托管发展中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5.有效性原则：托管部/托管发展中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6.效益性原则：托管部/托管发展中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》、《商业银行托管业务监督管理办法（试行）》等法律法规，托管部/托管发展中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通

银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部/托管发展中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

第五部分　相关服务机构

一、直销机构

名称:中欧基金管理有限公司

住所: 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

法定代表人：窦玉明

联系人：马云歌

电话：021-68609602

传真：021-50190017

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

二、代销机构

各销售机构的具体名单见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。基金管理人可以根据情况针对某类基金份额变更、增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点。各销售机构具体销售时间以及提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

三、登记机构

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 层

法定代表人：窦玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

联系人：王音然

四、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：陈臻

经办律师：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

五、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：许培菁

经办会计师：许培菁、龚圣然

第六部分　基金的历史沿革与存续

一、本基金的历史沿革

中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1241 号）注册，基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 11 月 13 日进行公开募集，并于当天结束募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 17 日生效。

为更好地实现本基金“在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益”的投资目标，本基金管理人拟增加投资范围中的投资品种。另外，为进一步降低投资者成本以提高产品竞争力，本基金拟降低费率。基于上述考虑并维护基金份额持有人利益，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定召开基金份额持有人大会。2016 年 8 月 31 日中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，主要变更了本基金的投资范围和费率，并基于上述变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金的其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2016 年 9 月 5 日起，原《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且修订后的《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

二、基金份额的变更登记

基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额必要信息的变更。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止。

法律法规另有规定时，从其规定。

四、基金份额的类别

本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额、E 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值＝该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。

第七部分　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。具体的销售网点将由基金管理人在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

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额自 2015 年 11 月 26 日起开放日常申购、赎回及转换业务。

本基金 E 类基金份额自 2023 年 5 月 5 日起开放日常申购、赎回及转换业务。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 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申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

五、申购和赎回的数量限制

1、其他销售机构的销售网点每个账户首次单笔申购的最低金额为 1 元（含申购费，下同），追加申购的单笔最低金额为 0.01 元。在不违反前述规定的前提下，各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

直销机构每个账户首次单笔申购的最低金额为 10,000 元，追加申购的单笔最低金额为单笔 10,000 元。其他销售机构的销售网点的投资者欲转入直销机构进行交易须受直销机构最低申购金额的限制。投资者当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额和追加申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制，本招募说明书另有约定的除外。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，各类份额每次赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。若某笔份额减少类业务导致单个基金交易账户的 A 类、C 类或 E 类基金份额余额不足 0.01 份的，登记机构有权对该基金份额持有人在该基金交易账户持有的该类基金份额做全部赎回处理（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户等业务，具体种类以相关业务规则为准）。

3、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的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

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

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计

算基金份额净值。

2、申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）申购费用

本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额在投资人申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费。申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金对通过直销中心申购本基金A类基金份额和E类基金份额的养老金客户实施优惠的申购费率。

养老金客户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等，具体包括：

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）职业年金计划；

7）养老目标基金；

8）个人税收递延型商业养老保险等产品。

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，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。其他客户指除通过基金管理人直销中心申购的养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额或E类基金份额的养老金客户的优惠申购费率见下表：

申购费率	申购金额（M）	费率
	M＜100 万元	0.10%

	100 万元≤M＜500 万元	0.06%
	M≥500 万元	每笔 1000 元

其他客户申购本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额的申购费率见下表：

申购费率	申购金额（M）	费率
	M＜100 万元	1.00%
	100 万元≤M＜500 万元	0.60%
	M≥500 万元	每笔 1000 元

（2）申购份额的计算

1）若投资者选择申购 A 类基金份额或 E 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额或 E 类基金份额的基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

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 类基金份额或 E 类基金份额的基金份额净值

例：某投资人（其他客户）投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额，其对应的申购费率为 1.00%，假设申购当日本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000/（1＋1.00%）＝99,009.90 元

申购费用＝100,000－99,009.90＝990.10 元

申购份额＝99,009.90/1.0000＝99,009.90 份

即：投资人（其他客户）投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额，假设申购当日本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 A 类基金份额或 E 类基金份额 99,009.90 份。

2）若投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

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：某投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.0000＝100,000.00 份

即：投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 C 类基金份额 100,000.00 份。

3、赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（1）赎回费用

1）对于本基金 A 类基金份额，赎回费率见下表：

	持有期限（N）	费率
赎回费率	N＜7 日	1.50%
	7 日≤N＜30 日	0.75%
	30 日≤N＜365 日	0.50%
	365 日≤N＜730 日	0.25%
	N≥730 日	0

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

2）对于本基金 C 类基金份额，赎回费率见下表：

	持有期限（N）	费率
赎回费率	N＜7 日	1.5%
	7 日≤N＜30 日	0.50%
	N≥30 日	0

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算）

3）对于本基金 E 类基金份额，赎回费率见下表：

	持有期限（N）	费率
赎回费率	N＜7 日	1.50%
	7 日≤N＜30 日	0.75%
	30 日≤N＜180 日	0.50%
	N≥180 日	0.00%

（注：赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

（2）赎回金额的计算

赎回金额＝赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费＝赎回份额×赎回当日该类基金份额净值×赎回费率

净赎回金额＝赎回金额－赎回费

例：

某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有期限为 5 个月，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额＝10,000×1.0500＝10,500.00 元

赎回费用＝10,500.00×0.50%＝52.50 元

净赎回金额＝10,500.00－52.50＝10,447.50 元

即：某投资人赎回持有的 10,000 份本基金 A 类基金份额，持有期限为 5 个月，假设赎回当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为 10,447.50 元。

4、A 类基金份额、E 类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。C 类基金份额不收取申购费用。

5、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。对持续持有期少于 30 日的投资人，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25%计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。（注：1 个月以 30 日计算）

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

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并进行公告。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

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

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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

8、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。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被部分或全部拒绝，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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认

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

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。

十一、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。

十二、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。

十三、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。

十四、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。

十五、基金份额的冻结和解冻

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

十六、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。

第八部分　基金的投资

一、投资目标

在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中小企业私募债、中央银行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券等)、质押及买断式债券回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、现金、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：

本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%－3%，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

三、投资策略

1、大类资产配置策略

本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。

2、股票投资策略

本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，在以整个宏观策略为前

提下，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股。

（1）行业分析

在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后，精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。

（2）个股选择

本基金在选择个股时关注如下几个方面：

1）基本面

主营业务竞争力强，包括技术、品牌、政策或者规模等方面

盈利能力强，不仅有短期的业绩与盈利支撑，盈利的稳定性、持续性好，具有长期的投资空间

良好的治理结构

管理层能力强

商业模式优越

2）估值水平

本基金除了关注个股的基本面之外，还要考查个股业绩的增长性和估值的匹配程度，如果估值比较合理或者低估就会选择买入并坚持持有，相反如果估值已透支了未来几年的增长，即业绩增长的速度与股价和市盈率不相匹配，那么就会相应减持这种股票。

3）对于存托凭证的投资，本基金将依照境内上市交易的股票，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选优质上市公司；并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。

3、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

（1）久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

（2）期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

（3）类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

（4）个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序

偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

8、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

9、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（6）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（7）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（9）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%；

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

（11）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%；

（12）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%；

（13）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；

（14）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；

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

（16）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

（18）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；

（19）本基金若参与国债期货、股指期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，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%；

4）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%；

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

6）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%；

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

8）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；

9）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；

（20）本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

1）本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3）本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约数计算；

（21）本基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的全部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的 20%；

（22）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；

（23）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。

除上述第（2）、（13）、（17）、（18）项外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，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照调整后的规定执行。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

五、投资决策

1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资策略组负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受风险管理部、监察稽核部的监督和信息技术部、基金运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，对基金投资的重大问题进行决策，并在必要时做出修改。

投资策略组负责人负责本策略组内投资策略和内外部沟通工作，并监控、审查基金资产的投资业绩和策略风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神，结合证券池及有关研究报告，负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓

位。

4、投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

5、风险分析与绩效评估

研究部负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*15%

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于 A 股股票与债券等资产，相应选取与之匹配的 A 股指数与债券指数作为基准要素。其中，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%。同时基于投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将股票资产与债券资产所对应的基准要素

权重分别设置为 15%与 85%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，在以整个宏观策略为前提下，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，选取中证 800 指数作为股票部分的基准要素。

中证 800 指数由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股组成，综合反映沪深市场中大、中、小市值公司的整体表现，具有较高的市场代表性，适合作为 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

（3）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，选取中债-综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-综合全价（总值）指数的样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反映中国债券市场的总体走势，适合作为债券部分的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

中证 800 指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 000906，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

中债-综合全价（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制发布，指数代码为 CBA00203，指数具体信息详见中国债券信息网，网址：www.chinabond.com.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为

计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中的各指数的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括超额收益、配置偏离等，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

七、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

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

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

4、有利于基金资产的安全与增值；

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

九、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本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。

基金托管人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金 2026 年第 1 季度报告，所载数据截至 2026 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,717,443,137.83	13.77
	其中：股票	1,717,443,137.83	13.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,360,740,633.70	83.08
	其中：债券	10,360,740,633.70	83.08
	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	150,006,575.34	1.20
	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	122,095,757.79	0.98

8	其他资产	121,075,930.47	0.97
9	合计	12,471,362,035.13	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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	31,380,370.00	0.25
B	采矿业	177,494,861.17	1.43
C	制造业	939,000,059.65	7.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,540,770.00	0.24
E	建筑业	14,637,743.00	0.12
F	批发和零售业	41,901,360.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	131,748,450.66	1.06
H	住宿和餐饮业	10,748,000.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,633,885.06	0.94
J	金融业	89,616,065.00	0.72
K	房地产业	29,902,623.00	0.24
L	租赁和商务服务业	23,209,068.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	44,566,095.29	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	3,593,505.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,098,568.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,659,664.00	0.24
S	综合	712,050.00	0.01
	合计	1,717,443,137.83	13.83

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000688	国城矿业	2,011,800	78,198,666.00	0.63
2	688777	中控技术	1,200,000	77,340,000.00	0.62
3	600026	中远海能	3,035,100	66,772,200.00	0.54
4	600938	中国海油	1,500,000	60,000,000.00	0.48
5	600519	贵州茅台	35,000	50,750,000.00	0.41

6	300750	宁德时代	123,200	49,489,440.00	0.40
7	002493	荣盛石化	3,669,700	44,036,400.00	0.35
8	601318	中国平安	710,000	40,313,800.00	0.32
9	002008	大族激光	600,000	36,768,000.00	0.30
10	600989	宝丰能源	1,000,000	29,060,000.00	0.23

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	102,380,691.31	0.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,187,852,569.28	41.78
	其中：政策性金融债	2,181,947,958.90	17.57
4	企业债券	382,170,024.56	3.08
5	企业短期融资券	271,215,235.08	2.18
6	中期票据	3,978,786,649.63	32.04
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	295,686,639.45	2.38
9	其他	142,648,824.39	1.15
10	合计	10,360,740,633.70	83.43

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	250203	25 国开 03	2,300,000	227,759,232.88	1.83
2	250208	25 国开 08	2,200,000	221,830,400.00	1.79
3	112620040	26 广发银行 CD040	2,000,000	197,188,328.77	1.59
4	250421	25 农发 21	1,800,000	182,168,728.77	1.47
5	250431	25 农发 31	1,800,000	181,624,586.30	1.46

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动	风险说明

				（元）	
IM2606	IM2606	-45	-66,434,400.00	3,140,540.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					3,140,540.00
股指期货投资本期收益（元）					4,212,055.88
股指期货投资本期公允价值变动（元）					3,140,540.00

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
T2606	10 年期国债 2606	-500	-541,900,000.00	971,950.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					971,950.00
国债期货投资本期收益（元）					-1,533.97
国债期货投资本期公允价值变动（元）					971,950.00

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以争取回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以力争相应债券组合的超额收益。

11 投资组合报告附注

11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行广东省分行（国家外汇管理局广东省分局、

中国人民银行广东省分行营业管理部)的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有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。

11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	19,381,280.25
2	应收证券清算款	10,730,272.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	90,964,377.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	121,075,930.47

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 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。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第九部分　基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日2015年11月17日，本次更新基金业绩截止日2026年3月31日。

中欧瑾通灵活配置混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2021.01.01-2021.12.31	6.00%	0.15%	-1.21%	0.59%	7.21%	-0.44%
2022.01.01-2022.12.31	-1.33%	0.16%	-10.80%	0.64%	9.47%	-0.48%
2023.01.01-2023.12.31	2.87%	0.13%	1.39%	0.33%	1.48%	-0.20%
2024.01.01-2024.12.31	7.35%	0.27%	5.89%	0.13%	1.46%	0.14%
2025.01.01-2025.12.31	6.51%	0.18%	0.39%	0.10%	6.12%	0.08%
2015.11.17-2026.03.31	76.37%	0.16%	24.04%	0.48%	52.33%	-0.32%

中欧瑾通灵活配置混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④

				准差④		
2021.01.01-2021.12.31	5.69%	0.15%	-1.21%	0.59%	6.90%	-0.44%
2022.01.01-2022.12.31	-1.63%	0.16%	-10.80%	0.64%	9.17%	-0.48%
2023.01.01-2023.12.31	2.56%	0.13%	1.39%	0.33%	1.17%	-0.20%
2024.01.01-2024.12.31	7.03%	0.27%	5.89%	0.13%	1.14%	0.14%
2025.01.01-2025.12.31	6.19%	0.18%	0.39%	0.10%	5.80%	0.08%
2015.11.17-2026.03.31	69.82%	0.16%	24.04%	0.48%	45.78%	-0.32%

中欧瑾通灵活配置混合 E

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2023.05.08-2023.12.31	-0.06%	0.12%	-0.95%	0.28%	0.89%	-0.16%
2024.01.01-2024.12.31	7.34%	0.27%	5.89%	0.13%	1.45%	0.14%
2025.01.01-2025.12.31	6.51%	0.18%	0.39%	0.10%	6.12%	0.08%
2023.05.08-2026.03.31	15.87%	0.21%	5.17%	0.17%	10.70%	0.04%

本基金于 2016 年 9 月修改投资范围，增加政府支持机构债、国债期货、股票期权为投资标的。本产品于 2020 年 10 月修改投资范围，增加存托凭证为投资标的。

第十部分　基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十一部分　基金资产的估值

一、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。

二、估值对象

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

三、估值方法

1、证券交易所发行的有价证券的估值

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

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

（3）交易所发行未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价或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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价或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；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）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、全国银行间债券市场交易品种的估值

全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

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

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

6、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7、股指期货合约的估值方法

（1）评估股指期货合约价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值。

（2）股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

9、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

10、股票期权合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

11、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。

12、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。

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

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

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

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。

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

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额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。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值

的准确性、及时性。当基金份额净值（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：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人

对基金净值按约定予以公布。

八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误等其他原因，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资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

第十二部分　基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、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；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每季度进行分红评估，在符合有关基金分红条件的前提下，若截至每年 1 月、4 月、7 月、10 月第五个交易日，每份基金份额可供分配利润高于 0.01 元（含），则基金管理人可在其后 30 日内提出分红方案进行评估；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

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》的有关规定在指定媒介公告。

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

六、基金收益分配中发生的费用

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

第十三部分　基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金的销售服务费；

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、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的相关账户的开户及维护费用；

10、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 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 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 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 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、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.30%÷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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。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 4－10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分　基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

二、基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

第十五部分　基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应

当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（七）临时报告

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

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、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、基金份额净值估值错误达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、调整本基金份额类别设置；

22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或法律法规、中国证监会规定及基金合同约定的其他事项。

（八）澄清公告

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

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十）清算报告

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

（十一）股指期货的投资情况

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金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。

（十二）国债期货的投资情况

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。

（十三）股票期权的投资情况

基金管理人应当在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

（十四）资产支持证券的投资情况

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十五）中小企业私募债的投资情况

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

（十六）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、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、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第十六部分　风险揭示

本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金。

一、市场风险

金融市场价格受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响基金收益。

2、利率风险

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

3、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

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，导致了基金资产损失的风险。

二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会

影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

三、流动性风险

1、巨额赎回风险

若是由于投资者大量赎回而导致基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

2、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

四、策略风险

本基金存在投资策略风险，即本基金的业绩表现不一定领先于市场平均水平。另外，在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

五、其它风险

1、技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

2、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。

3、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

六、特有风险

本基金为混合型基金，资产配置策略对基金的投资业绩具有较大的影响。在类别资产配置中可能会由于市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，

导致资产配置偏离优化水平，为组合绩效带来风险。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易量不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险，以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险，可能影响基金资产变现能力，造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则，审慎参与中小企业私募债券的投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

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

本基金的投资范围包括国债期货。国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、流动性风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。市场风险指由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。流动性风险指当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。保证金风险指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。信用风险指交易对手不愿或无法履行契约的风险。操作风险则指因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

第十七部分　基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

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

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

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同生效后，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；4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十八部分　基金合同内容摘要

基金合同内容摘要见附件一。

第十九部分　基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

第二十部分　对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人应在 T＋2 日后及时通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向在该季度内有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

二、在线服务

基金份额持有人可以通过基金管理人的网站 www.zofund.com 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

三、查询与咨询服务

基金管理人客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客户服务热线 021－68609700，400－700－9700（免长途话费）的语音系统或登录基金管理人网站 www.zofund.com 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一至周五，9：00－17：00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

四、投诉受理

基金份额持有人可拨打客户服务热线 021－68609700，400－700－9700（免长途话费）投诉直销机构和其他销售机构的人员及其服务。

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

第二十一部分　其他应披露事项

以下为本基金管理人自 2025 年 5 月 1 日至 2026 年 4 月 30 日刊登于中国证监会指定媒介的公告

序号	公告事项	披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	2025-06-03
2	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	2025-06-03
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“海光信息”股票估值方法的公告	2025-06-06
4	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	2025-06-09
5	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 7 月）	2025-07-08
6	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2025-07-10
7	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	2025-07-15
8	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2025-07-16
9	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第二季度报告的提示性公告	2025-07-19
10	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	2025-07-19
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告的提示性公告	2025-08-30
12	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告	2025-08-30
13	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2025-10-17
14	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	2025-10-18
15	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	2025-10-22
16	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2025-10-23
17	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	2025-10-23
18	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第三季度报告的提示性公告	2025-10-23
19	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2026-01-13

20	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	2026-01-16
21	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	2026-01-20
22	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	2026-01-22
23	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	2026-01-22
24	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	2026-03-31
25	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	2026-03-31
26	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	2026-03-31
27	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	2026-04-14
28	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	2026-04-22
29	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	2026-04-22

第二十二部分　招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当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；也可按工本费购买本招募说明书复印件。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十三部分　备查文件

一、备查文件包括：

1．中国证监会准予中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2.《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3.《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4．法律意见书

5．基金管理人业务资格批件、营业执照

6．基金托管人业务资格批件、营业执照

7．中国证监会规定的其他文件

二、备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2026 年 7 月 27 日

附件一　基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金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）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；

（2）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；

（3）销售基金份额；

（4）按照规定召集基金份额持有人大会；

（5）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（6）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（7）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；

（8）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；

（9）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（10）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；

（11）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；

（12）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；

（13）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；

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

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

（16）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申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照基金法、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）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，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（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，法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高基金销售服务费，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金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、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金销售服务费和除基金管理费、基金托管费以外的其他应由基

金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

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

3、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，基金管理人无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

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

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决

意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

三、基金合同解除和终止的事由、程序

（一）基金合同的变更

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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同生效后，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；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算

公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、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，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

附件二　基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

（二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中小企业私募债、中央银行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券等)、质押及买断式债券回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、现金、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：

本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%－3%，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

1.本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%；

2.每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

3.本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5.本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

6.本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

7.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

9.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%；

10.本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

11.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%；

12.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%；

13.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；

14.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；

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

16.本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

18.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；

19.本基金若参与国债期货、股指期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，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%；

4）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%；

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

6）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%；

7）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债

券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

8）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；

9）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；

20.本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

1）本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3）本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约数计算；

21.本基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的全部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的 20%；

22.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

23.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。

除上述第 2、13、17、18 项外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，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照调整后的规定执行。

（3）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。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，应当符合本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同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

（4）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1．基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。

基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2．基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

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

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

2．基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

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

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

（6）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1. 基金投资流通受限证券，应遵守有关法律法规规定。

2. 此处的流通受限证券上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受

限证券。基金投资流通受限证券，还应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

3. 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。 基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4. 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5. 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

（7）基金托管人对基金投资中期票据的监督。

1. 基金投资中期票据应遵守《关于证券投资基金投资中期票据有关问题的通知》等有关法律法规的规定，并与基金托管人签订《基金投资中期票据风险控制

补充协议》。

2.基金管理人应将经董事会批准的相关投资决策流程、风险控制制度以及基金投资中期票据相关流动性风险处置预案提供给基金托管人，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的情况进行监督。

基金管理人确定基金投资中期票据的，应根据《托管协议》及相关补充协议的约定向基金托管人提供其托管基金拟购买中期票据的数量和价格、应划付的金额等执行指令所需相关信息，并保证上述信息的真实、准确、完整。

基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资中期票据前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资中期票据出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

（8）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本基金投资中小企业私募债券进行监督，监督内容包括但不限于以下几个方面：

1.基金投资中小企业私募债券应遵守《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》等法律法规规定。

2.基金在投资中小企业私募债券前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中小企业私募债券的投资决策流程和风险控制制度。基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。

3.如未来有关监管部门对基金投资中小企业私募债券另有规定或托管协议当事人对基金投资中小企业私募债券的监督管理另有约定时，从其约定。

（9）基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对

基金投资其他方面进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额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认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人

对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、证券账户、期货账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、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的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人在限期内纠正。

四、基金财产保管

（一）基金财产保管的原则

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户、期货账户和债券托管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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整和独

立。

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

（二）基金的银行存款账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

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

（4） 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

（5） 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

（三）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理：

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

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

算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

（四）债券托管账户的开立和管理

（1） 基金合同生效后，基金托管人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

（2） 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

（五）其他账户的开立和管理

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，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。

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由基金管理人保管。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的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，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果以双方认可的方式反馈给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

（1）证券交易所发行的有价证券的估值：

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

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

③交易所发行未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所

含的债券应收利息得到的净价或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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价或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；

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

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

（3）全国银行间债券市场交易品种的估值

全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）股指期货合约的估值方法

①评估股指期货合约价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值。

②股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（8）国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

（9）持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

（10）股票期权合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

（11）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。

（12）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。

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

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

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

（二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

（1）如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第（1）－（11）、（13）进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任；

（2）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

（3）基金管理人、基金托管人按估值方法的第（12）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。

由于不可抗力原因，或证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误等其他原因，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资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

（三）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值 ；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（四）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（五）基金账册的建立

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

（六）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（七）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。中期报告在上半年结束之日起两个月内公告；年度报告在每年结束之日起三个月内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人

在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将

复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基

金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。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。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

（二）基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、被依法撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、被依法撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

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

8、基金财产清算的公告

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

组进行公告。

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。