

中信保诚基金管理有限公司

关于以通讯方式召开中信保诚幸福消费混合型证券投资基金 基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，中信保诚幸福消费混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2025年4月2日起，至2025年4月28日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

《议案》的内容说明详见《〈关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》，详见附件四。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2025年4月1日，即在2025年4月1日交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

（一）纸质投票

纸质表决票的填写和寄交方式如下：

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（包括基金管理人认可的业务专用章，下同），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他有效身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票；

（5）以上各项中的公章、批文、业务专用章、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（以表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的以下地址：

收件人：中信保诚基金管理有限公司客户服务部

收件地址：上海浦东新区银城路16号工银大厦19楼（邮政编码：200120）

联系电话：400 666 0066（按提示转人工客服）

备注：请在信封表面注明：“中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

（二）其他投票方式

基金管理人可以根据实际需要，增加或调整本次基金份额持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

2、受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载等方式获取授权委托书样本。

基金管理人可以根据实际需要，增加或调整本次基金份额持有人大会的授权方式并在规定媒介上公告。

(1) 基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供基金份额持有人的个人有效身份证明文件复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

③合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

④以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

(2) 对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的，可通过邮寄授权

文件和所需的相关文件至基金管理人办公地点或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

4、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次纸面授权的，以表示具体表决意见的纸面授权为准；

(2) 如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权；

(3) 基金份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权；

(4) 如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；

(5) 如委托人既进行委托授权，自身又通过纸质表决票直接参与表决的，则以委托人自身有效表决为准。

5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2025年4月21日16:30时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、纸面表决票效力的认定如下：

(1) 纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2025年4月28日17:00以后送达基金管理人的，为无效表决。

(2) 纸面表决票的效力认定

①纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如纸面表决票上的表决意见未选、多选、表决意见空白、表决意见模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i. 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii. 送达时间为同一天的，如果能判断收到时间先后的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；若无法判断收到时间先后的，则视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

iii. 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

2、《议案》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；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400 666 0066

联系人：朱嫣

联系电话：（021）6864 9788

电子邮件：contact.us@citicprufunds.com.cn

传真：（021）5012 0895

网址：<http://www.citicprufunds.com.cn>

2、监督员：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路660号

联系电话：（021）6215 4848，6217 8903（直线）

联系人：林奇

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：(021)3135 8666

九、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定，本次持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，根据《基金合同》，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召集基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

3、基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告，就本次会议相关情况做必要说明，请予以留意。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站及中国证监会基金电子披露网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电400 666 0066咨询。

5、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

附件一：《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》

附件二：《授权委托书》（样本）

附件三：《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四：《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》的说明

中信保诚基金管理有限公司

2025年3月28日

附件一：

关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案

中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境的变化，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》有关约定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议修改基金合同等有关事项，主要修改内容包括在基金投资范围增加港股通标的股票、科创板、国债期货、股票期权、信用衍生品等，删除期权，并相应调整本基金投资比例限制、投资策略、业绩比较基准、估值方法等相关内容，并根据法律法规更新情况完善相关内容。具体内容详见附件四《〈关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人办理本次修改基金合同等有关具体事宜，包括但不限于根据《〈关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》相关内容对《基金合同》等法律文件进行修订等。

以上提案，请予审议。

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

2025年3月28日

附件二：

授权委托书

本人（或本机构）特此授权 _____ 代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2025 年 4 月 28 日的以通讯方式召开的中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若中信保诚幸福消费混合型证券投资基金在法定时间内重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： _____

委托人证件号码（填写）： _____

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定、《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》及本公告要求的授权委托书。此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字或盖章后均为有效。

2、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件三：

中信保诚幸福消费混合型证券投资基金

基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案			
基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章			
年 月 日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票（但其他各项符合会议通知规定的）均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。			

附件四：

《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》的说明

一、声明

根据市场环境变化，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》。

《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》需经提交有效表决票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，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案，不表明其对修改基金合同后基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证。

二、本次变更方案要点

1、修改基金的投资范围、投资策略、投资限制和业绩比较基准等相关内容

《基金合同》第十二部分“基金的投资”中，在“二、投资范围”中增加了港股通标的股票、科创板、国债期货、股票期权、信用衍生品等，删除期权，并相应调整本基金投资比例限制、投资策略、业绩比较基准等相关内容。

2、增加基金的估值原则、补充修改估值方法等相关内容

根据基金投资范围的调整，并结合现行法律法规和实际情况，修改《基金合同》第十四部分“基金资产估值”中的估值方法等，并增加估值原则。

3、修改基金的费用与税收

由于基金投资范围的调整，并结合现行法律法规和实际情况，修改《基金合同》第十五部分“基金费用与税收”，在“基金费用的种类”中增加因投资港股

通标的股票而产生的各项合理费用。

4、修改基金的信息披露

根据投资范围的修改，在《基金合同》第十八部分“基金的信息披露”中增加投资港股通标的股票、国债期货、股票期权、信用衍生品等投资标的的信息披露内容。同时，根据现行法律法规及基金变更注册实际情况，修改信息披露相关内容。

5、其他相关事项的修改

修改基金的历史沿革、基金的存续等内容。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定、监管要求相应修订《基金合同》的其他内容。

三、《基金合同》修订的生效

《基金合同》修订生效时间详见届时相关公告。在基金管理人公告的《基金合同》生效日，变更注册后的《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》生效。

四、修改方案的可行性

1、法律层面不存在障碍

中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同有关事项不违反相关法律法规的规定及《基金合同》的约定，需经提交有效表决票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，符合相关法律法规的规定及《基金合同》的约定。

2、不存在技术方面的障碍

本次变更方案不涉及基金注册登记系统、估值核算系统等方面的重大调整，不存在技术障碍。

五、《基金合同》修改的主要风险及预备措施

1、基金份额持有人大会不能成功召集的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，基金份额持有人大会应当有代表二分之

一以上基金份额的持有人参加，方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召集，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

2、议案被持有人大会否决的风险

在设计持有人大会方案之前，基金管理人拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对持有人大会方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

六、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系：

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

公司网站：www.citicprufunds.com.cn

风险提示：

本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将来表现，基金管理人所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。

投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

附件：《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》

中信保诚基金管理有限公司

2025年3月28日

附件：《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》

章节	变更注册前	变更注册后
全文	指定媒介、指定报刊、指定网站	<u>规定媒介、规定报刊、规定网站</u>
第一部分 前言/一、 订立本基金 合同的目的、依据和 原则	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是 《中华人民共和国合同法》 (以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是 <u>《中华人民共和国民法典》</u> 、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、 <u>《公开募集证券投资基金运作管理办法》</u> (以下简称“《运作办法》”)、 <u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u> (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》”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言	三、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费混合型证券投资基金更名而来，信诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费股票型证券投资基金变更而来，信诚幸福消费股票型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对信诚幸福消费股票型证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	三、中信保诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费混合型证券投资基金更名而来，信诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费股票型证券投资基金变更而来，信诚幸福消费股票型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对信诚幸福消费股票型证券投资基金募集的注册 <u>以及变更注册</u> ，并不表明其对本基金的 <u>投资价值、收益和市场前景</u> 做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

第一部分 前言		六、本基金可以投资内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称“港股通机制”)允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)。若本基金投资于港股通标的股票,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,港股通标的股票不能及时卖出,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。
第一部分 前言		七、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通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。
第一部分 前言	六、本基金的 投资范围 包括存托凭证,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还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。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。	八、本基金的 投资范围 包括存托凭证,如 投资 ,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还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。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

第一部分 前言		九、本基金可投资于科创板，若本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。
第一部分 前言		十、为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。
第二部分 释义	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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，于 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 10、《销售办法》：指中国证监会于 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》以及颁布机关对其不时做出的修订 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 12、《运作办法》：指中国证监会于 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布、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》及发	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，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 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》以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》：指中国证监会于 2014 年 7 月 7 日颁布、同年

	布机关对其不时做出的修订 14、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 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会 20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 21、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 24、销售机构：指中信保诚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代理协议，代为办理基金销售业务的机构 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、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 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	<u>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</u> 13、《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 14、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<u>以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对上述流动性受限资产范围进行调整</u> 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构</u> 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》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，<u>包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u> 21、投资人：指个人投资者、机构投资者和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 24、销售机构：指中信保诚基金
--	--	---

	56、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	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 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 35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），<u>n 为自然数</u> 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（如本基金参与港股通交易且遇香港联合交易所法定节假日或因其他原因暂停营业或港股通暂停交易的情形，基金管理人有权暂停办理基金份额的申购和赎回业务） 56、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《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 59、摆动定价机制：指当开放式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，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对前述摆动定价机制的定义进行调整 62、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指内地证券交易所
--	---	--

		分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票 63、<u>港股通标的股票</u>：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票 64、<u>信用衍生品</u>：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具 65、<u>信用保护买方</u>：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方 66、<u>信用保护卖方</u>：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方 67、<u>名义本金</u>：亦称交易名义本金，指一笔为信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准
第三部分 基金的基本情况/八、 基金份额类别	八、基金份额类别 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调低现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但需提前公告。	八、基金份额类别 <u>在不违反法律法规的规定、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。</u>
第四部分 基金份额的发售	第四部分基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间	删除。

	见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者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。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 5、认购申请的确认 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 三、基金份额认购金额的限制	
--	---	--

	1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。 4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不得撤销。	
第四部分 基金的历史沿革		第四部分基金的历史沿革 <u>中信保诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费混合型证券投资基金更名而来，信诚幸福消费混合型证券投资基金由信诚幸福消费股票型证券投资基金变更而来。</u> <u>信诚幸福消费股票型证券投资基金由中国证监会证监许可[2014]124号文核准，于2014年3月31日至2014年4月24日期间公开发售。经中国证监会书面确认，《信诚幸福消费股票型证券投资基金基金合同》于2014年4月29日生效。基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</u> <u>信诚幸福消费混合型证券投资基金是由信诚幸福消费股票型证券投资基金更名而来。经本基金管理人与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自2015年8月3日起本基金名称变更为“信诚幸福消费混合型证券投资基金”；基金类别变更为“混合型”。</u> <u>2023年9月4日，信诚幸福消费混合型证券投资基金更名为中信保诚幸福消费混合型证券</u>

		投资基金。 中信保诚幸福消费混合型证券投资基金经中国证监会 2025 年 3 月 17 日证监许可[2025]512 号文准予变更注册，并经 202X 年 X 月 X 日基金份额持有人大会审议并通过《关于中信保诚幸福消费混合型证券投资基金修改基金合同等有关事项的议案》，同意本基金投资范围中增加港股通标的股票、科创板、国债期货、股票期权、信用衍生品等，删除期权，并相应调整本基金投资比例限制、投资策略、业绩比较基准、估值方法等相关内容，并根据法律法规更新情况完善相关内容，同步修改基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要中上述调整涉及的相关条款表述。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 202X 年 X 月 X 日起，修订后的《中信保诚幸福消费混合型证券投资基金基金合同》生效。
第五部分 基金的存续	第五部分基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会	第五部分<u>基金的存续</u> <u>《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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于 6 个月内召集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。</u>

	确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：— 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；— 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。— 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。—	
第六部分 基金份额的申购与赎回 /二、申购和赎回的开放日及时间	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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。	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（<u>如本基金参与港股通交易且遇香港联合交易所法定节假日或因其他原因暂停营业或港股通暂停交易的情形，基金管理人有权暂停办理基金份额的申购和赎回业务</u>），但基金管理人根据法

		律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /三、申购 与赎回的原 则	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则 <u>5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。</u>
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /四、申购 与赎回的程 序	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 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本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。	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 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 <u>或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</u> 时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 <u>如遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。</u> 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 <u>本金</u> 退还给投资人。

第六部分 基金份额的 申购与赎回 /六、申购 和赎回的价格、费用及 其用途	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，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，<u>经中国证监会同意</u>，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以赎回申请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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	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，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，<u>经履行适当程序</u>，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书<u>及基金产品资料概要</u>中列示。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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书<u>及基金产品资料概要</u>中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以赎回申请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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 <u>7、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。</u>
---	---	--

第六部分 基金份额的 申购与赎回 /七、拒绝 或暂停申购 的情形	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： 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。 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。 发生上述第1、2、3、5、6、7、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全部或部分拒绝的，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。	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： 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市<u>或者港股通临时暂停</u>，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、<u>登记机构、支付结算机构等因</u>异常情况导致基金销售系统、<u>基金销售支付结算系统</u>、基金登记<u>结算</u>系统或基金会计系统无法正常运行。 <u>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日申购金额上限、单日净申购比例上限、单个投资者累计持有份额上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。</u> <u>10、基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足。</u> 发生上述第1、2、3、5、6、7、<u>10、11</u>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<u>规定媒介</u>上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项<u>本金</u>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。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /八、暂停 赎回或延缓 支付赎回款 项的情形	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： 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。 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备	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： 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市<u>或者港股通临时暂停</u>，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 <u>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。</u>

	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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。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。	发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应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。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /九、巨额 赎回的情形 及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式 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。 （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	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。 （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

	并处理，无优先权并以以下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) 暂停赎回：连续 2 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 当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。	为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 (3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。 3、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /十、暂停 申购或赎回 的公告和重 新开放申购 或赎回的公 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 2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。 3、如发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类基金份额净值。	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。 3、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；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。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 /十五、基 金份额的冻 结和解冻	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。基金份额被冻结

		的,被冻结部分产生的权益根据有关机关要求及登记机构业务规则决定是否一并冻结。 <u>如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。</u>
第六部分 基金份额的 申购与赎回		<u>十六、基金份额的转让</u> <u>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基金份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,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。</u>
第六部分 基金份额的 申购与赎回		<u>十八、基金管理人可在法律法规允许的范围内,在不影响基金份额持有人实质利益的前提下,根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。</u>
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务/一、 基金管理人	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 (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: (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; (13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券; (15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路16号19层 (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: (11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请; (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业务; (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;

	构； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 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： (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； (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；	(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、<u>非交易过户、定期定额投资、转托管等</u>业务规则； <u>(17)在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整基金费率结构和收费方式；</u> 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： (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，<u>但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；</u> (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，<u>保存期限不低于法律法规的规定；</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务/二、基金托管人	二、基金托管人 (二) 基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户和期货账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算； 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： (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	二、基金托管人 (二) 基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算； 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： (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

	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； （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 <u>15 年以上</u>； （12）<u>建立</u>并保存基金份额持有人名册； （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；	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，<u>但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外</u>； （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，<u>保存期限不低于法律法规的规定</u>； （12）<u>从基金管理人或其委托的登记机构处接收</u>并保存基金份额持有人名册； （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<u>银行业监督管理机构</u>，并通知基金管理人；
第七部分 基金合同当事人及权利义务/三、基金份额持有人	三、基金份额持有人 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： （3）依法申请赎回其持有的基金份额； （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁； 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》； （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险； （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；	三、基金份额持有人 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： （3）依法<u>转让或者</u>申请赎回其持有的基金份额； （8）对基金管理人、基金托管人、基金<u>服务</u>机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁； 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》、<u>招募说明书等信息披露文件</u>； （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，<u>自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策</u>，自行承担投资风险； （4）<u>交</u>纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用； （9）<u>提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性</u>； （10）<u>遵守基金管理人、基金托</u>

		<u>管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；</u>
第八部分 基金份额持有人大会		<u>本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</u>
第八部分 基金份额持有人大会/ 一、召开事由	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： （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外； （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低基金管理费、基金托管费； （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率、调整基金份额类别设置或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式； （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。	一、召开事由 1、<u>除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外</u>，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： （5）<u>调整</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规要求提高销售服务费率的除外； （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； 2、<u>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</u>，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： （2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低销售服务费率、调整基金份额类别设置或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式； （5）<u>基金管理人、登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，在不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务规则；</u> <u>（6）基金在履行适当程序后推出新业务或服务；</u> <u>（7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有</u>

		人大会的其他情形。
第八部分 基金份额持有人大会/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	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 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。	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 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。
第八部分 基金份额持有人大会/四、基金份额持有人出席会议的方式	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、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 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： （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；	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、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 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<u>或会议通知等相关公告中指定的其他方式</u>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<u>或会议通知等相关公告中指定的其他方式</u>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： （2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，

(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的基金份额持有人在权益登记日持有的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见，方可召开； (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，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。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、电话或其他方式书面方式授权他人代为出席会议并表决。	不影响表决效力； (3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）； 若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人在权益登记日持有的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见，方可召开； (4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 3、在法律法规或监管机构允许的情况下，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。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。
---	--

第八部分 基金份额持有人大会/ 六、表决	六、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。	六、表决 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具 <u>表决</u> 意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
第八部分 基金份额持有人大会/ 七、计票	七、计票 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。	七、计票 2、通讯开会 在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
第八部分 基金份额持有人大会/ 八、生效与公告	八、生效与公告 基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。	八、生效与公告 基金份额持有人大会的决议自 <u>表决通过</u> 之日起生效。
第八部分 基金份额持有人大会/ 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定	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： 4、在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	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： 4、 <u>若</u> 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；	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；
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 /二、基金管理人、基金托管人的更换程序	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过； 4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案； 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告； 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值； 7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案； （二）基金托管人的更换程序	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，<u>决议自表决通过之日起生效</u>； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案； 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告； 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值； 7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。审计费由基金财产承担； （二）基金托管人的更换程序

	2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案； 5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告； 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值； 7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。 （三）基金管理人同时更换的条件和程序。 3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。	2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，<u>决议自表决通过之日起生效</u>； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须<u>报</u>中国证监会备案； 5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后<u>依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介</u>公告； 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人<u>或临时基金托管人</u>与基金管理人核对基金资产总值； 7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。<u>审计费由基金财产承担。</u> （三）基金管理人同时更换的条件和程序。 3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后<u>依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上联合公告。</u> <u>（四）新基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原任基金管理人或原任基金托管人应依据法律法规和基金合</u>
--	---	---

		同的规定继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序		三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人应与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
第十二部分 基金的投资 /二、投资范围	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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。 基金的投资组合比例为：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）占基金资产的60%-95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的60%，其中投向消费服务行业上市公司发行的股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证不超过基金资产净值的3%。	二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含<u>主板、创业板、科创板</u>及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、<u>港股通标的股票</u>、<u>债券（含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）</u>、货币市场工具、资产支持证券、<u>债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品</u>以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 <u>本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。</u> <u>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</u>在履行适当程序后，可以将其

	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。	<u>纳入投资范围。</u> 基金的投资组合比例为：<u>股票资产（含存托凭证）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（含存托凭证）的 50%，投向消费服务行业上市公司发行的股票（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u> <u>如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。</u>
第十二部分 基金的投资 /三、投资策略	三、投资策略 （4）权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。 （5）股指期货投资策略 基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货	三、投资策略 （2）股票投资策略 <u>4）港股通标的股票投资策略</u> <u>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将通过自上而下及自下而上相结合的方法，严选安全边际较高的港股通标的股票进行投资。</u> <u>5）存托凭证投资策略</u> 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。 ... <u>（4）衍生品投资策略</u> <u>为了更好地实现投资目标，基金还可投资于股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品和其他经中国证监会允许的衍生工具。</u> <u>本基金可运用股指期货以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。</u>

	来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。 —(6)—存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。 <u>投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还可运用股指期货来对冲如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险，以进行有效的现金管理。</u> <u>本基金按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在严格控制风险的前提下，结合期权定价模型投资股票期权，提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。</u> <u>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。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</u> <u>本基金将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。</u> <u>(5) 融资业务投资策略</u> <u>本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资业务。</u> <u>利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金</u>
--	--

		现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。 <u>未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标和风险收益特征的前提下,经履行适当程序后,相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。</u>
第十二部分 基金的投资 /四、投资 限制	四、投资限制 1、组合限制 (1) 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)占基金资产的60%-95%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的60%,其中投向消费服务行业上市公司发行的股票的比例不低于非现金基金资产的80%; (2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; (3) 本基金持有一家上市公司的股票,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%;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%; (5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; (6) 本基金管理人管理的全部	四、投资限制 1、组合限制 (1) <u>股票资产(含存托凭证)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(含存托凭证)的50%,投向消费服务行业上市公司发行的股票(含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的80%;</u> (2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、<u>国债期货、股票期权</u>合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; (3) 本基金持有一家公司发行的<u>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)</u>,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<u>(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算)</u>,不超过该证券的10%;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%;

	基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；— —(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%； ... —(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；— —(15)本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； —(16)本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%； —(17)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%； ... 除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项以外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。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。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	... <u>(11)本基金若参与股指期货交易，应当遵守下列要求：</u> <u>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%；</u> <u>2) 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；</u> <u>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%；</u> <u>4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</u> <u>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%；</u> <u>(12)本基金若参与国债期货交易，应当遵守下列要求：</u> <u>1) 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%；</u> <u>2) 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；</u> <u>3) 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</u>
--	---	---

	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 ... （7）依照法律、行政法规有关规定和中国证监会禁止的其他活动。 法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关规定限制。 <u>值的 30%；</u> <u>4）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；</u> <u>5）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%；</u> <u>（13）本基金若参与股票期权交易，应当遵守下列要求：</u> <u>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%；</u> <u>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；</u> <u>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乘数计算；</u> <u>（14）本基金不得持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不得持有合约类信用衍生品，持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的 100%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；</u> <u>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不符合前述所规定比例限制的，基金管理人应在 3 个月之内进行调整；</u> <u>（15）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值</u>
--	---

		之和,不得超过基金资产净值的 95%; ... <u>(18)本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;</u> ... 除上述第(2)、(9)、(14)、(16)、(17)项以外,因证券/期货市场波动、<u>证券发行人</u>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,<u>但中国证监会规定的特殊情形除外</u>。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。<u>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</u>。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。 <u>如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准</u>。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。 ... 2、禁止行为 ... (7)法律、行政法规和中国证监会<u>规定禁止</u>的其他活动。 <u>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</u>
--	--	--

		<u>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。</u> 法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，<u>经履行适当程序后</u>，则本基金投资不再受相关规定限制或<u>以变更后的规定为准</u>。
第十二部分 基金的投资 /五、业绩 比较基准	五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准：80%×中证内地消费主题指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。 本基金主要投资于消费服务行业的股票。中证内地消费主题指数成份股由主要消费行业股票和可选消费行业股票组成，反映沪深 A 股市场中消费行业公司股票的整体表现，对消费行业股票具有较强的代表性，一适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述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。 如果本基金业绩比较基准停止发布或更改名称，或今后市场中出现更具有代表性的业绩比	五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准：60%×中证内地消费主题指数收益率+20%×中证港股通大消费主题指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。 本基金主要投资于消费服务行业的股票。中证内地消费主题指数成份股由主要消费行业股票和可选消费行业股票组成，反映沪深 A 股市场中消费行业公司股票的整体表现，对消费行业股票具有较强的代表性。中证港股通大消费主题指数从港股通范围内选取大消费领域上市公司证券作为指数样本，反映港股通范围内大消费主题上市公司证券的整体表现。中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述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。

	较基准，或者更科学的复合指数权重比例，本基金将根据实际情况对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。	如果本基金业绩比较基准停止发布或更改名称，或今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。
第十二部分 基金的投资 /六、风险 收益特征	六、风险收益特征 本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。	六、风险收益特征 本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 <u>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，如投资，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。</u>
第十二部分 基金的投资 /七、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		七、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 <u>1、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；</u> <u>2、不谋求对上市公司的控股；</u> <u>3、有利于基金财产的安全与增值；</u> <u>4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</u>
第十三部分 基金的财产 /三、基金 财产的账户	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。	<u>三、基金财产的账户</u> <u>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的</u> <u>其他专用账户。开立的基金专用</u> <u>账户与基金管理人、基金托管</u> <u>人、基金销售机构和基金登记机</u> <u>构自有的财产账户以及其他基</u> <u>金财产账户相独立。</u>

第十四部分 基金资产估值/一、估值日	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。	一、估值日 本基金的估值日为本基金相关的证券/ <u>期货</u> 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。
第十四部分 基金资产估值/二、估值对象	二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、 权证 、股指期货、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、股指期货 <u>合约</u> 、 <u>国债期货合约</u> 、 <u>股票期权合约</u> 、 <u>信用衍生品</u> 、 <u>债券</u> 、 <u>资产支持证券</u> 和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
第十四部分 基金资产估值/三、估值原则		<u>三、估值原则</u> <u>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。</u> <u>（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。</u> <u>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。</u> <u>（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</u>

		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，<u>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。</u> <u>(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。</u>
第十四部分 基金资产估值/四、估值方法	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；— —(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；— —(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收	四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1)交易所上市的有价证券(包括股票等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化<u>且</u>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<u>公允价值</u>及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。<u>。</u> <u>(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外)，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的当日的估值全价进行估值。</u> <u>(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外)，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供</u>

	利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日本债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；— —(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；— 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (1)送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；— (2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；— —(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。— 3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。— 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处	的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。— (4)对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。— (5)交易所上市或挂牌转让但不存在活跃市场的有价证券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值或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其公允价值。— 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。— (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。— (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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则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
--	---	---

	的市场分别估值。 5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 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，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。	技术确定公允价值。 <u>(4) 有明确锁定期的股票，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。</u> 3、全国银行间市场交易品种的估值 <u>(1) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种(另有规定的除外)，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种(另有规定的除外)，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。</u> <u>(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，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其公允价值。</u> 4、投资证券衍生品的估值方法 <u>(1) 本基金投资股指期货合约、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。</u>
--	---	---

		<u>(2) 本基金投资股票期权合约, 根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。</u> <u>(3) 信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值, 但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 依照有关法律法规及企业会计准则要求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其公允价值。</u> <u>5、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。</u> <u>6、汇率</u> <u>本基金外币资产价值计算中, 涉及主要货币对人民币汇率的, 应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。</u> <u>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。</u> <u>8、基金参与融资业务的, 应参照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。</u> ... <u>10、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息, 或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种, 第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人是在与基金托管人协商一致后, 可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。</u> <u>12、当发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以采用摆动定</u>
--	--	--

		价机制,以确保基金估值的公平性。 13、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。 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,基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后,按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。
第十四部分 基金资产估值/五、估值程序	四、估值程序 1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后,该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,均精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。	五、估值程序 1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后,该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,均精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。
第十四部分 基金资产估值/六、估值错误的处理	五、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下: (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	六、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下: (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

	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。	理人应当公告，<u>并报中国证监会备案</u>。 (3) 前述内容如法律法规或监管机<u>构</u>另有规定的，从其规定处理。
第十四部分 基金资产估值/八、基金净值的确认	七、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人	八、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金净值信息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<u>工作日</u>交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人
第十四部分 基金资产估值/十、特殊情况的处理	九、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券/期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。	十、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <u>11</u> 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券/期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，<u>有关会计制度变化</u>或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
第十五部分 基金费用与税收/一、基金费用的种类	一、基金费用的种类 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； ...	一、基金费用的种类 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、<u>审计费、公证费、仲裁费</u>和诉讼费； ... <u>7、基金的账户开户费、账户维护费用；</u> ... <u>10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</u>

第十五部分 基金费用与 税收/二、 基金费用计 提方法、计 提标准和支 付方式	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 上述“一、基金费用的种类中第4—9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。	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
第十五部分 基金费用与 税收/五、 基金税收	五、基金税收 本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。	五、基金税收 本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 <u>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。</u>
第十六部分 基金的收益 与分配/ 三、基金收 益分配原则	三、基金收益分配原则 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。	三、基金收益分配原则 5、法律法规或监管机 <u>构</u> 另有规定的，从其规定。
第十六部分 基金的收益 与分配/ 五、收益分 配方案的确定、公告与 实施	五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。	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， <u>由基金管理人依照《信息披露办法》在规定媒介公告。</u>
第十六部分 基金的收益 与分配/ 六、基金收 益分配中发 生的费用	六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法， 依照《业务规则》 执行。	六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法 <u>等有关事项遵循相关规定。</u>

第十七部分 基金的会计 与审计/ 一、基金会 计政策	一、基金会计政策 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。	一、基金会计政策 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确认。
第十七部分 基金的会计 与审计/ 二、基金的 年度审计	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合 <u>《中华人民共和国证券法》规定</u> 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。
第十八部分 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。	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》、 <u>《流动性风险管理规定》</u> 、《基金合同》及其他有关规定。 <u>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。</u>
第十八部分 基金的信息 披露/二、 信息披露义 务人	二、信息披露义务人 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。	二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内， <u>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”）</u> 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。
第十八部分 基金的信息 披露	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。	四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。 <u>如</u> 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。
第十八部分 基金的信息 披露/五、 公开披露的 基金信息	五、公开披露的基金信息 （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。	五、公开披露的基金信息 <u>（二）基金净值信息</u> 《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 <u>规定网站</u> 披露一次 <u>各类</u> 基金份额净值和基金份额累计净值。

	（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。 （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。 （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。 22、调整基金份额类别设置； （十一）投资股指期货相关公告 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决策和投资目标等。	（四）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<u>规定网站</u>上，并将年度报告提示性公告登载在<u>规定报刊</u>上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过<u>符合《中华人民共和国证券法》规定</u>的会计师事务所审计。 （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当<u>依照《信息披露办法》编制临时报告书，并登载在指定报刊和规定网站上。</u> <u>22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u> <u>23、调整基金份额分类方法及规则、变更收费方式、停止现有基金份额的销售；</u> <u>24、基金推出新业务或服务；</u> <u>25、变更业绩比较基准；</u> （九）投资股指期货信息披露 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<u>交易政策</u>、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<u>交易政策</u>和<u>交易</u>目标等。 （十）投资国债期货信息披露 <u>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，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。</u> <u>（十一）投资信用衍生品的信息</u>
--	---	--

		<u>披露</u> <u>基金管理人应当在定期报告和招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响，以及是否符合既定的投资目标及策略。</u> <u>（十二）投资资产支持证券信息披露</u> <u>本基金投资资产支持证券，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。</u> <u>（十三）投资港股通标的股票的信息披露</u> <u>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）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。</u> <u>（十四）投资证券公司短期公司债券信息披露</u> <u>本基金投资证券公司短期公司债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会规定媒介披露所投资证券公司短期公司债券的名称、数量等信息，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）等文件中披露证券公司短期公司债券的投资情况。</u> <u>（十五）参与融资业务信息披露</u> <u>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</u>
--	--	---

		<u>参与融资交易的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。</u> <u>(十六)投资股票期权信息披露</u> <u>基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等,并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</u> <u>(十七)投资于非公开发行股票等流通受限证券的信息披露</u> <u>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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。</u>
第十八部分 基金的信息披露		<u>八、暂停或延迟信息披露的情形</u> <u>1、不可抗力;</u> <u>2、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;</u> <u>3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情形;</u> <u>4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它情况。</u>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算/ 一、《基金合同》的变更	一、《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	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<u>法律法规规定和基金合同约定</u>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。 2、关于《基金合同》变更的基金

	金份额持有人大会决议生效后 方可执行，自决议生效后两日 内在指定媒介公告。	份额持有人大会决议生效后方 可执行，自决议生效后 <u>依照《信 息披露办法》</u> 在 <u>规定媒介</u> 公告。
第十九部分 基金合同的 变更、终止 与基金财产 的清算/ 二、《基金 合同》的终 止事由	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：	二、《基金合同》的终止事由 有下列情形之一的， <u>经履行相关 程序后</u> ，《基金合同》应当终止：
第十九部分 基金合同的 变更、终止 与基金财产 的清算/	三、基金财产的清算 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、期货相关业务资格的注册 会计师、律师以及中国证监会 指定的人员组成。基金财产清 算小组可以聘用必要的工作人 员。 5、基金财产清算的期限为6个 月。	三、基金财产的清算 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、 <u>符合《中华人 民共和国证券法》</u> 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。 5、基金财产清算的期限为6个 月， <u>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。</u>
第十九部分 基金合同的 变更、终止 与基金财产 的清算/ 六、基金财 产清算的公 告	六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须 及时公告；基金财产清算报告 经具有证券、期货相关业务资 格的会计师事务所审计并由律 师事务所出具法律意见书后报 中国证监会备案并公告。基金 财产清算公告于基金财产清算 报告报中国证监会备案后5个 工作日内由基金财产清算小组 进行公告。基金财产清算小组 应当将清算报告登载在 <u>指定网 站</u> 上，并将清算报告提示性公 告登载在指定报刊上。	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 <u>符合《中华人民共和国证券法》 规定</u> 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 <u>规定网站</u> 上，并将清算报告提示性公告 登载在 <u>规定报刊</u> 上。
第十九部分 基金合同的 变更、终止 与基金财产 的清算/	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。	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， <u>保存期限不 低于法律法规的规定。</u>

七、基金财产清算账册及文件的保存		
第二十部分 违约责任	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责： 3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使使其投资权而造成的损失等。	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责： 3、基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则<u>投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等。</u>
第二十部分 违约责任	三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。	三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误<u>或未能避免错误发生或虽发现错误但因前述原因无法及时更正的</u>，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
第二十一部分 争议的处理和适用的法律	《基金合同》受中国法律管辖。	《基金合同》受中国法律 <u>（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门和台湾法律）</u> 管辖并从其解释。
第二十二部分 基金合同的效力	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并由 <u>中国证监会变更注册，经202X年X月X日基金份额持有人大</u>

	续，并经中国证监会书面确认后生效。 4、《基金合同》正本一式<u>六</u>份，除上报有关监管机构一式<u>二</u>份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。	<u>会审议通过，自 202X 年 X 月 X 日起</u>生效。 4、《基金合同》正本一式<u>三</u>份，除上报有关监管机构<u>一</u>份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。
--	---	---