

东吴基金管理有限公司

关于以通讯方式召开东吴新产业精选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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，东吴新产业精选混合型证券投资基金的基金管理人东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2020 年 11 月 26 日起，至 2020 年 12 月 24 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2020 年 12 月 28 日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

邮编：200120

联系人：李佳

联系电话：021-50509888-8219

请在信封表面注明：“东吴新产业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用。”

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-821-0588 咨询。

二、会议审议事项

《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《东吴新产业精选混合型证券投资基金转型方案说明书》（附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 11 月 25 日，即在 2020 年 11 月 25 日下午交易时间结

束后,在本基金注册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与本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）下载并打印表决票。

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，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）个人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，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）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，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

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自 2020 年 11 月 26 日起，至 2020 年 12 月 24 日 17:00 以前（送达时间以基金管理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办公地址，并请在信封表面注明：“东吴新兴产业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

联系人：李佳

联系电话：021-50509888-8219

五、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票人在基金托管人（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第二个工作日（即 2020 年 12 月 28 日）进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，则基金管理人可自行授权 3 名监票人进行计票，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达基金管理人的，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）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，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，或未能在规定时间之内送达基金管理人的，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：

①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；

②送达时间为同一天的，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；

③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，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

2、《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》应当由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 50%以上通过；

3、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提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和代理投票授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定，并与注册登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自生效之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定，基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但权益登记日仍为 2020 年 11 月 25 日。

重新召开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做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做出授权，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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：东吴基金管理有限公司

联系人：李佳

联系电话：021-50509888-8219

传真：021-50509884

网址：www.scfund.com.cn

邮编：200135

2、监督人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系方式：021-62154848

联系人：林奇

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-821-0588 咨询。

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，就基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本公告的有关内容由东吴基金管理有限公司负责解释。

东吴基金管理有限公司

2020 年 11 月 24 日

附件一：《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《东吴新产业精选混合型证券投资基金转型方案说明书》

附件一：

关于东吴新产业精选混合型证券投资基金 转型有关事项的议案

东吴新产业精选混合型证券投资基金基金份额持有人：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开东吴新产业精选混合型证券投资基金（以下简称“东吴新产业精选混合”）基金份额持有人大会，对东吴新产业精选混合实施转型，内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例并相应变更基金名称、基金类别，变更基金份额持有人大会程序、基金合同当事人权利义务、估值方法、基金费用等事项。具体安排可参见《东吴新产业精选混合型证券投资基金转型方案说明书》（见附件四）。

为实施东吴新产业精选混合转型方案，提议授权基金管理人办理本次东吴新产业精选混合转型的有关具体事宜，并根据《东吴新产业精选混合型证券投资基金转型方案说明书》对《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

东吴基金管理有限公司

2020年11月24日

附件二:

东吴新产业精选混合型证券投资基金

基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称:			
基金份额持有人证件号码(身份证件号/营业执照号):			
基金份额持有人基金账户号:			
受托人(代理人)姓名/名称:			
受托人(代理人)证件号码(身份证件号/营业执照号):			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金转型有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人(代理人)签字或盖章 日期: ____年____月____日			

说明:

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见；表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见；
- 2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额；
- 3、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，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；如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，或未能在规定时间内送达基金管理人的，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、本表决票可从本基金管理人网站(www.scfund.com.cn)下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托_____先生 / 女士或_____单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2020 年 12 月 24 日的以通讯方式召开的东吴新产业精选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。表决意见以受托人的表决意见为准。

授权有效期自本授权委托书签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若东吴新产业精选混合型证券投资基金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。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人基金账户号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托日期：____年____月____日

附注：

- 1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。
- 3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

东吴新产业精选混合型证券投资基金转型方案说明书

一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《东吴新产业精选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，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议关于东吴新产业精选混合型证券投资基金（以下简称“东吴新产业精选混合”）转型有关事项的议案。

2、本次东吴新产业精选混合转型方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过，因此转型方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次东吴新产业精选混合基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

（一）更名

基金名称由“东吴新产业精选混合型证券投资基金”更名为“东吴新产业精选股票型证券投资基金”。同时，《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》将变更为《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》。

（二）基金类别变更

基金类别由“混合型证券投资基金”变更为“股票型证券投资基金”。

（三）调整投资范围及投资比例

投资范围新增“内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票”

投资组合比例由“本基金为混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于股票资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或

到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

调整为“本基金为股票型基金，投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；本基金投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

（四）调整投资策略

投资策略表述略有调整，详见“（七）本次基金合同具体修改内容请参见基金合同修改对照表”中相关内容。

（五）调整业绩比较基准

业绩比较基准由“75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数”调整为“中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20%”

（六）调整赎回费率

1、原赎回费率

持有时间	赎回费率
7天以内（不含7天）	1.50%
7天到1年（含1年）	0.50%
1年-2年（含2年）	0.25%
2年以上	0

注：1年指 365 天

本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的 25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

2、调整后的赎回费率

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

T≥180日	0%
--------	----

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日（含）但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 90 日（含）但小于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 180 日（含）的基金份额不收取赎回费。

（七）本次基金合同具体修改内容请参见基金合同修改对照表（如下）

章节	修改前表述	修改后表述
全文	东吴新产业精选 混合型 证券投资基金	东吴新产业精选 股票型 证券投资基金
一、前言	（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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。 （三）东吴新产业精选混合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”）核准。中国证监会对本基金募集的核准，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。 （五）本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。	（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》”）、<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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、<u>《证券投资基金信息披露管理办法》</u>（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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。 （三）东吴新产业精选股票型证券投资基金由东吴新产业精选混合型证券投资基金变更注册而来。中国证监会对东吴新产业精选混合型证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。 <u>（五）本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。</u> <u>（六）投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。</u> <u>（七）本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制试点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”），可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</u> <u>本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因</u>

		投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。本基金投资港股的具体风险请参见招募说明书“十六、风险揭示”部分。 <u>（八）本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
二、释义	在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义： 1. 基金或本基金：指东吴新产业精选混合型证券投资基金 6. 招募说明书：指《东吴新产业精选<u>混合型</u>证券投资基金招募说明书》及其更新 <u>7. 基金产品资料概要：指《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）</u> <u>8. 基金份额发售公告：指《东吴新产业精选混合型证券投资基金份额发售公告》</u> <u>10. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 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</u> <u>11. 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</u> <u>12. 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集</u>	在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义： 1. 基金或本基金：指东吴新产业精选<u>股票型证券投资基金</u>，由东吴新产业精选<u>混合型证券投资基金变更注册而来</u> 6. 招募说明书：指《东吴新产业精选<u>股票型</u>证券投资基金招募说明书》及其<u>定期</u>的更新 <u>8. 《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》修改的《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</u> <u>9. 《销售办法》：指中国证监会 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》及颁布机关对其不时做出的修订</u> <u>10. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6</u>

<u>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</u>	<u>月8日颁布、同年7月1日实施的《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</u>
<u>13. 《运作办法》：指中国证监会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</u>	<u>11. 《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</u> <u>15. 内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称“沪港通”）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称“深港通”）</u> <u>16. 港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖沪港通、深港通规定范围内的香港联合交易所上市的股票</u>
23. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务 24. 销售机构：<u>指直销机构和代销机构</u> 25. 直销机构：指东吴基金管理有限公司 26. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销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 27. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点 28. 注册登记业务：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、基金份额注册登记、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等 32. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 34. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月	23. 基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 24. 销售机构：指东吴基金管理有限公司<u>以及</u>符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构 25. 注册登记业务：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、基金份额注册登记、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<u>和办理非交易过户等</u> 29. 基金合同生效日：指《东吴新兴产业精选股票型证券投资基金基金合同》生效日

	<u>39. 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> <u>40. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段</u> <u>42. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为</u> <u>44. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</u>	<u>35. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准）</u> <u>36. 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</u> <u>39. 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</u>
	<u>47. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式</u> <u>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</u> <u>57. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易</u>	<u>42. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式</u> <u>51. 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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u> <u>52. 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介</u> <u>53. 不可抗力：指本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</u>
三、基金的基本情况	(二) 基金的类别 混合型证券投资基金 (四) 基金的投资目标 本基金为混合型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享新兴产业所带来的投资机会，追求超越市场的收益。 <u>(五) 基金的最低募集份额总额和金额</u>	(二) 基金的类别 股票型证券投资基金 (四) 基金的投资目标 本基金为股票型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。

	<u>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。</u> <u>(六) 基金份额面值和认购费用</u> <u>基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。</u> <u>本基金的认购费率最高不超过 5%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。</u>	
四、基金的历史沿革	<u>基金份额的发售</u> <u>(一) 基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</u> <u>1. 发售时间</u> <u>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</u> <u>2. 发售方式</u> <u>通过基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告)公开发售。</u> <u>3. 发售对象</u> <u>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和机构投资者以及合格境外机构投资者。</u> <u>(二) 基金份额的认购</u> <u>1. 认购费用</u> <u>本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率不得超过认购金额的 5%。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，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。</u> <u>2. 募集期利息的处理方式</u> <u>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，其中利息以注册登记机构的记录为准。</u> <u>3. 基金认购份额的计算</u> <u>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</u> <u>4. 认购份额余额的处理方式</u> <u>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。</u> <u>(三) 基金份额认购金额的限制</u> <u>1. 投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u> <u>2. 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允许撤销。</u>	<u>东吴新产业精选股票型证券投资基金经中国证监会证监许可【2011】1021 号文核准募集，自 2011 年 8 月 29 日起至 2011 年 9 月 23 日公开募集，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，《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 28 日生效。基金管理人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</u> <u>根据中国证监会于 2014 年 7 月 7 日颁布的《运作办法》对基金类别的规定，基金管理人将“东吴新产业精选股票型证券投资基金”变更为“东吴新产业精选混合型证券投资基金”。</u> <u>2020 年 12 月 28 日，东吴新产业精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于东吴新产业精选混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例并相应变更基金名称、基金类别，变更基金份额持有人大会程序、基金合同当事人权利义务、估值方法、基金费用等事项并相应修改基金合同。自基金份额持有人大会决议生效之日次日起，《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》失效且《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》同时生效。</u>

	<u>3. 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。</u> <u>4. 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。</u>	
五、基金的存续	基金备案 (一)基金备案的条件 <u>1. 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，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，且基金募集达到基金备案条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起 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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。</u> <u>2. 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。</u> <u>3. 本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。</u> (二)基金募集失败 <u>1. 基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。</u> <u>2. 如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内返还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。</u> <u>3. 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</u> (三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额 <u>基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000</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，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</u> <u>法律法规另有规定时，从其规定。</u>

	万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。	
六、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招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。	(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招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。
	(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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。	(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(若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准)，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。
	(三) 申购与赎回的原则 3. 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； 4. 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。	(三) 申购与赎回的原则 3. 基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按“先进先出”的原则，对该基金份额持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即登记确认日期在前的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率； 4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，但申请经注册登记机构受理的不得撤销。
	(四) 申购与赎回的程序 1. 申购和赎回的申请方式 投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。 2. 申购和赎回申请的确认	(四) 申购与赎回的程序 1. 申购和赎回的申请方式 投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人交付款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。 2. 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,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。 3. 申购和赎回的款项支付 申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。 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。	基金管理人应以交易时间结束前受理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,本基金注册登记机构在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)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。 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、赎回的确认以注册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。基金管理人可在法律法规允许的范围内,依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整,并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 3. 申购和赎回的款项支付 申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成立或无效,基金管理人或基金管理人指定的销售机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。 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。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款项划付时间相应顺延。
(五) 申购和赎回的金额 1. 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书。 2. 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书。 3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书。 5. 基金管理人可以根据市场情况,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。	(五) 申购和赎回的金额 1. 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。 2. 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。 3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。 5. 基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途 3. 赎回金额的计算及处理方式: 本基金赎回金额	(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途 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》，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。 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，<u>不高于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费</u>，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。 6. <u>本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。</u>本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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，<u>针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者</u>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。	的计算详见《招募说明书》。<u>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当日基金份额净值并扣除相应的费用</u>，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。 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，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，<u>具体费率详见招募说明书。赎回费用按照法律法规规定的比例纳入基金财产，具体比例详见招募说明书，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。</u> 6. 本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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，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。 8. <u>当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>
(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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 4. 基金管理人<u>认为</u>接受某笔或某些申购申请可	(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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。<u>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。</u> 4. 基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会

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, <u>从而</u>损害现有基金份额持有人利益的情形。 <u>6. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u> 发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	影响或损害现有基金份额持有人利益 <u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</u>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, <u>或发生其他</u>损害现有基金份额持有人利益的情形。 <u>6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u> 发生上述 <u>1、2、3、5、6、8 项</u>暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请 <u>全部或部分被拒绝的</u>,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 <u>并公告</u>。
(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: 4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 <u>5. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u> 发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,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, <u>并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额</u>。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过 20 个工作日,并在指定媒介上公告。投资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予以公告。	(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: 4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。 <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,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。</u> 发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,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。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过 20 个工作日,并在指定媒介上公告。投资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予以公告。
(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	(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。 (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）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20% 时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。 对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。 在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并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	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。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20% 以上的部分，可以进行延期办理。</u> 对于当日<u>未延期办理</u>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. 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, <u>并在两日内</u> 在指定媒介上刊登公告。	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, <u>同时</u> 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<u>应在</u>规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。 3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日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<u>开放日</u>的基金份额净值。 4. 如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个<u>开放日</u>的基金份额净值。	(十) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1. 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人<u>当日应立即向中国证监会备案,并</u>在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。 3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日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<u>工作日</u>的基金份额净值。 4. 如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个<u>工作日</u>的基金份额净值。
	(十五) 基金的冻结和解冻 基金注册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,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。	(十五) 基金<u>份额</u>的冻结和解冻 基金注册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,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。
		<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>
		<u>(十七) 其他业务</u> <u>在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下,基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人可制定相应的业务规则,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</u>
七、基金合同当事人及权	(一) 基金管理人 名称: 东吴基金管理有限公司 住所: <u>上海市浦东新区源深路 279 号</u> 办公地址: <u>上海市浦东新区源深路 279 号</u> 邮政编码: <u>200135</u>	(一) 基金管理人 名称: 东吴基金管理有限公司 住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室</u>

利 义 务	法定代表人：邓晖 <u>成立时间</u>：2004 年 9 月 2 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004] 132 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1 亿元 存续<u>期间</u>：持续经营	法定代表人：邓晖 <u>设立日期</u>：2004 年 9 月 2 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]132 号 组织形式：有限责任公司<u>（国内合资）</u> 注册资本：1 亿元 存续<u>期限</u>：持续经营 <u>联系电话</u>：021-50509888
	<u>（四）基金管理人的权利</u> 根据《基金法》及其他有关<u>法律法规</u>，基金管理人的权利<u>为</u>： <u>1. 自本基金合同生效之日起，依照有关</u>法律法规和<u>本基金合同的规定</u>独立运用基金财产； <u>2. 依照基金合同获得</u>基金管理费以及法律法规规定或<u>监管部门</u>批准的其他<u>收入</u>； <u>3. 发售</u>基金份额； <u>4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</u> <u>5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金</u><u>认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务</u>的规则，<u>在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；</u> <u>6. 根据本</u>基金合同及有关规定监督基金托管人，<u>对于基金托管人违反了本基金合同或有关</u>法律法规规定的行为，<u>对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；</u> <u>7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理</u>申购和赎回申请； <u>8. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法</u>为基金进行融资、<u>融券</u>； <u>9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；</u> <u>10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；</u> <u>11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</u> <u>12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；</u>	<u>（二）基金管理人的权利与义务</u> <u>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：</u> <u>（1）依法募集资金；</u> <u>（2）自《基金合同》生效之日起，根据</u>法律法规和<u>《基金合同》</u>独立运用并<u>管理</u>基金财产； <u>（3）依照《基金合同》收取</u>基金管理费以及法律法规规定或<u>中国证监会</u>批准的其他<u>费用</u>； <u>（4）销售</u>基金份额； <u>（5）按照规定</u>召集基金份额持有人大会； <u>（6）依据《基金合同》及有关法律</u>规定监督基金托管人，<u>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；</u> <u>（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；</u> <u>（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；</u> <u>（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；</u> <u>（10）依据《基金合同》及有关法律</u>规定决定基金收益的分配方案； <u>（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理</u>申购与赎回申请； <u>（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</u> <u>（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；</u> <u>（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</u> <u>（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</u> <u>（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和</u>

13. 依法召集基金份额持有人大会； 14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。 <u>(五)基金管理人的义务</u> 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为： 12依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； 23办理基金备案手续； 34自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产； 45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； 56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； 67除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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； 78依法接受基金托管人的监督； 8. 计算并公告基金净信息，确定基金份额申购、赎回价格； 910采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定； <u>10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</u> 11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告； 12. 编制季度报告、中期报告和年度报告； 13. 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； 14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。15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，不得向他人泄露； 15. 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； 16. 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	调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则； <u>(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的</u>其他权利。 <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：</u> <u>(1) 依法募集资金，</u>办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的申购、赎回和登记事宜； <u>(2) 办理基金备案手续；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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</u>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； <u>(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</u>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； <u>(7) 依法接受基金托管人的监督；</u> <u>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定</u>计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格； <u>(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</u> <u>(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；</u> <u>(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；</u> <u>(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> <u>(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；</u> <u>(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</u> <u>(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关</u>
--	---

份额持有人依法召集基金份额持有人大会； 17. 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； 18. 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； 19. 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； 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除； 21. 基金托管人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托管人追偿； 22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料； 23. 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； 24. 执行生效的基金份额持有人大会决议； 25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动； 26. 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理； 27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。	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； <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 15 年以上；</u> <u>(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</u> <u>下得到有关资料的复印件；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</u> <u>(25) 建立并保存基金份额持有人名册；</u> <u>(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。</u>
(二) 基金托管人 名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 <u>邮政编码：100033</u> 法定代表人：田国立 成立时间：2004 年 9 月 17 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字	(三) 基金托管人 名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 法定代表人：田国立 成立时间：2004 年 09 月 17 日 组织形式：股份有限公司

[1998]12 号 <u>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务</u> 组织形式：股份有限公司 注册资本：<u>贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元</u> 存续期间：持续经营	注册资本：<u>贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</u> 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号
<u>(六)基金托管人的权利</u> 根据《基金法》及其他有关<u>法律法规</u>，基金托管人的权利为： <u>1. 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收入；</u> <u>2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；</u> <u>3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；</u> <u>4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；</u> <u>5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；</u> <u>6. 依法召集基金份额持有人大会；</u> <u>7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；</u> <u>8. 法律法规和基金合同规定的</u>其他权利。 <u>(七)基金托管人的义务</u> 根据《基金法》及其他有关<u>法律法规</u>，基金托管人的义务为： <u>1. 安全保管基金财产；</u> <u>2. 设立专门的基金托管部，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；</u> <u>3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；</u>	<u>(四)基金托管人的权利与义务</u> <u>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：</u> <u>(1) 自《基金合同》生效之日起，依法法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；</u> <u>(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；</u> <u>(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</u> <u>(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；</u> <u>(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；</u> <u>(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；</u> <u>(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。</u> <u>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：</u> <u>(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；</u> <u>(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；</u> <u>(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</u>

4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产； 5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证； 6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户； 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<u>应予</u>保密，不得向他人泄露； 8.对基金财务会计报告、季度<u>报告、中期报告</u>和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施； 9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料； 10.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； 11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项； 12.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； 13.按照规定监督基金管理人的投资运作； 14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对； 15.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； 16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会； 17.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除； 18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；	产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立； (4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产； (5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证； (6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜； (7)保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露； (8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施； (11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上； (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；
--	--

19.参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； 20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人； 21.执行生效的基金份额持有人大会决议； 22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动； 23. 建立并保存基金份额持有人名册； 24.法律法规、一中国证监会和基金合同规定的其他义务。	(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配； (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人； (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除； (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿； (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议； (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
(三) 基金份额持有人 投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。 (八) 基金份额持有人的权利 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为： 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； 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼； 9.法律法规和基金合同规定的其他权利。 每份基金份额具有同等的合法权益。 (九) 基金份额持有人的义务 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为： 1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；	(五) 基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。 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

	<u>2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</u> <u>3. 在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；</u> <u>4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；</u> <u>5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；</u> <u>6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；</u> 7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。 <u>(十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。</u>	<u>等信息披露文件；</u> <u>(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；</u> <u>(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</u> <u>(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；</u> (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。
八、基金份额持有人大会	(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。 (二) 召开事由 1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会： (7) <u>提高</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准，<u>但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；</u> 2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会： (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用； (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；	(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。 <u>本基金份额持有人大会不设日常机构。</u> (二) 召开事由 1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会，<u>但法律法规、中国证监会另有规定的除外；</u> (7) <u>调整</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准； 2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会： (1) 调低<u>除</u>基金管理费、基金托管费<u>以外的</u>其他应由基金承担的费用； (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内<u>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</u>变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； <u>(6) 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，基金推出新业务或服务；</u> <u>(7) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内</u>

		<u>且在对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整本基金份额类别的设置；</u> <u>（8）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不利影响的前提下，基金管理人、注册登记机构、销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；</u>
	（三）召集人和召集方式 2. 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，应当自行召集。 3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。	（三）召集人和召集方式 2. 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，应当自行召集，<u>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。</u> 3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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<u>并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</u>
	（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 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书面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书面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书面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<u>书面</u>表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。	（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 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书面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书面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书面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，不影响计票和表决结果。
	（五）基金份额持有人出席会议的方式 <u>1. 会议方式</u>	（五）基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会<u>可通过现场开会方式、通讯</u>

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。 (2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。 (3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。 (4)会议的召开方式由召集人确定。 2. 召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时,现场会议方可举行: 1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%,下同); 2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备,到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。 (2)通讯开会方式 在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行: 1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告; 2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力; 4)本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上; 5)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托	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。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。 1. 现场开会方式。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. 通讯开会方式。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。在同时符合以下条件时,通讯会议方可举行: (1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告; (2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力; (3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出
---	---

<u>代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。</u>	<u>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50%，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；</u> <u>（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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。</u> <u>3. 在法律法规和监管机关允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用网络、电话、短信等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权；本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。</u>
（六）议事内容与程序 1. 议事内容及提案权 <u>（1）议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。</u> <u>（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。</u> <u>（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：—</u> <u>关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进</u> <u>行解释和说明。</u>	（六）议事内容与程序 1. 议事内容及提案权 议事内容为<u>关系基金份额持有人利益的重大事项</u>，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。 <u>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。</u> <u>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。</u>

<u>程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。</u> <u>(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。</u> <u>(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。</u> 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，<u>经合法执业的律师见证后</u>形成大会决议。 <u>大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表</u>作为该次基金份额持有人大会的主持人。 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)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额<u>数量</u>、委托人姓名(或单位名称)等事项。 (2) 通讯<u>方式</u>开会 在通讯<u>表决</u>开会的方式下，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<u>第2</u>个工作日在公证机关<u>及监督人</u>的监督下由召集	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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，<u>并形成大会决议。</u> <u>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</u>作为该次基金份额持有人大会的主持人。<u>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。</u> <u>会议</u>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<u>联系方式</u>等事项。 (2) 通讯开会 在通讯开会的方式下，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
---	--

人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。 3. 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。	表决并形成决议。
(七) 决议形成的条件、表决方式、程序 2. 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 一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 <u>50%</u>以上通过方为有效，除下列(2)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 特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。 3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。	(七) 决议形成的条件、表决方式、程序 2. 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 一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的<u>二分之一以上(含二分之一)</u>通过方为有效，除下列(2)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 特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、<u>本基金与其他基金合并</u>必须以特别决议通过方为有效。
(八) 计票 1. 现场开会 (1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人，但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。 (3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异 议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有 异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新 清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重 新清点结果。重新清点仅限一次。	(八) 计票 1. 现场开会 (1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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。 <u>(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。</u> <u>(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</u>

	2. 通讯方式开会 在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。	的效力。 2. 通讯开会 在通讯方式开会的情况下，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。
	(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式 1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第(二)条所规定的第(9)、(10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。 2. 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。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决议。 3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。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。	(九) <u>生效与公告</u> <u>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。</u> <u>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</u> 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<u>上</u>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。<u>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。</u>
	(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。	(十) <u>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。</u>
九、基金管理人、基金托管	(一) 基金管理人的更换 2. 基金管理人的更换程序 更换基金管理人必须依照如下程序进行： (1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额	(一) 基金管理人的更换 2. 基金管理人的更换程序 更换基金管理人必须依照如下程序进行： (1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额 10%以上<u>(含 10%)</u>的基

人的 更 换 条 件 和 程 序	持有人提名； (3) 核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；<u>更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后</u>方可执行； (6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在<u>新任基金管理人获得中国证监会核准</u>后 2 日内公告；	金份额持有人提名； (3) 临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人； (4) 备案：<u>更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应自决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案</u>； (7) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在<u>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</u>公告；
	(二) 基金托管人的更换 2. 基金托管人的更换程序 (1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名； (2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件； (3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，<u>更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后</u>方可执行； (6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在<u>新任基金托管人获得中国证监会核准</u>后 2 日内公告。	(二) 基金托管人的更换 2. 基金托管人的更换程序 (1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人提名； (2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件； (3) 临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人， (4) 备案：<u>更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应自决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案</u>； (7) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在<u>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</u>公告。
	(三) 基金管理人与基金托管人同时更换 1. 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人； 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<u>获得中国证监会核准</u>后 2 日内在指定媒介上联合公告。	(三) 基金管理人与基金托管人同时更换 1. 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上 (含 10%) 的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人； 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<u>生效后</u> 2 日内在指定媒介上联合公告。
	(四) 新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。	(四) 新任或临时基金管理人接收基金管理业务或新任或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。<u>原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本协议的约定收取基金管理费或基金托管费。</u>
	十、基金 基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定

托管	订立《东吴新产业精选 混合型 证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在 基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作 及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。	订立《东吴新产业精选 股票型 证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在 基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露 及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。
十一、基金份额的注册登记	(一)本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、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等。	(一)本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、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。
	(二)本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。	(二) 基金注册登记业务办理机构 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。
	(三)注册登记机构享有如下权利： 3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等； 5. 法律法规规定的其他权利。	(三) 基金注册登记机构的权利 注册登记机构享有如下权利： 3. 基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露； 5. 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。
	(四)注册登记机构承担如下义务： 3. 保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上； 4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外； 7. 法律法规规定的其他义务。	(四) 基金注册登记机构的义务 注册登记机构承担如下义务： 3. 妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年； 4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形 及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》 约定的其他情形除外； 7. 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。
十二、基金的投资	(一)投资目标 本基金为 混合型 基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。	(一)投资目标 本基金为 股票型 基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。
	(一)投资目标 本基金为 混合型 基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求	(一)投资目标 本基金为 股票型 基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求

超越市场的收益。 (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<u>国内</u>依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资<u>的</u>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。 本基金为<u>混合型</u>基金，投资组合中股票类资产投资比例<u>为基金资产的 60%-95%，其中，</u>投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于<u>股票</u>资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，<u>固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，</u>现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>其中，</u>现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	超越市场的收益。 (二) 投资范围 本基金的投资范围<u>主要</u>为具有良好流动性的金融工具，包括<u>内地</u>依法发行上市的股票（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、<u>内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、</u>债券（<u>包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等</u>）、货币市场工具、权证、资产支持证券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。 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。 本基金为<u>股票型</u>基金，投资组合中股票资产投资比例<u>不低于基金资产的 80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；</u>本基金投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于<u>非现金基金</u>资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(三) 投资策略 本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态<u>的</u>调整股票、债券、现金等大类资产的配置。 1、资产配置策略 <u>对于大类资产的配置，</u>本基金主要由投资研究团队根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平；在各大类资产投资比例限制前提下，根据<u>大</u>类资产风险收益分析结果，<u>并</u>结合本基金风险收益目标，最终确定、<u>调整</u>基金资产中股票、债券和现金的配置比例。 2、<u>选股</u>策略 1) <u>新兴产业类上市公司选股策略</u>	(三) 投资策略 本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态调整股票、债券、现金等大类资产的配置。 1、资产配置策略 本基金主要由投资研究团队根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平；在各大类资产投资比例限制前提下，根据<u>各</u>类资产风险收益分析结果，结合本基金风险收益目标，最终确定基金资产中股票、债券和现金的配置比例。 2、<u>股票投资</u>策略 <u>本基金根据对宏观经济运行、国家产业政策趋</u>

首先按照基金投资范围构建基金初选股票池，本基金新兴产业类上市公司投资范围包括“十二五”规划公布的七大战略性新兴产业上市公司和未列入七大战略性新兴产业范围的其它新兴产业类的上市公司；然后，本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，精选其中具有成长、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象。 A. 基金初选股票池构建 首先按照两大类对新兴产业类上市公司进行识别，分别为战略性七大新兴产业类上市公司和其它新兴产业类上市公司，形成新兴产业类上市公司基金初选股票池。 (1) 战略性七大新兴产业初选股票池构建 战略性新兴产业是以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。 ——根据2010年10月18日发布的《中共中央关于制定国民经济和社会发展第十二个五年规划的建议》中战略性新兴产业的排序和《决定》中对战略性新兴产业的详细说明，本基金对战略性新兴产业及其细分进行了以下梳理，并将归属于以下细分行业的上市公司纳入新兴产业类上市公司基金初选股票池。 图1 战略性新兴产业细分 资料来源：东吴基金 (2) 其它新兴产业类上市公司初选股票池构建 本基金所投资的未列入战略性新兴产业范围的新产业是指，以一定的重要技术突破和重要发展需求为基础，对经济社会发展具有重要带动作用，知识技术较为密集、物质资源消耗较少、成长潜力较大、经济效益较好的产业。 新兴产业本身是一个动态更新的概念，本基金管理人将持续跟踪新科研成果、新技术、新工艺、新商业模式、新目标市场和相关政策的变化所导致的最新产业形态和相关上市公司的变化。一方面，将那些运用更先进的技术和更新商业模式等的行业纳入新兴产业的投资范围；另一方面，对于随着原有的新技术和新商业模式等的推广而发展的行业，如果仍然具有较高	势、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定产业发展趋势，识别经济发展过程中具有良好发展前景的新产业及相关上市公司。在对上市公司的内在价值和安全边际进行研究的基础上，重点挖掘中国经济发展和结构转型环境下新兴产业的投资机会。 1) 根据国务院于2010年10月18日发布的《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》，新兴产业是指以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。包括但不限于节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业等。如果国家将来调整新兴产业范围，本基金相应调整。 2) 本基金通过定量和定性相结合的方法进行个股自下而上的选择。 在定性方面，主要考察公司是否具有良好的经济技术效应、是否能够带动一批产业的兴起及是否具有持久创新能力的特征；其次分析公司的核心技术或创新商业模式是否具有足够的市场空间，公司的盈利模式、产品的市场竞争力及其发展的稳定性；此外还将评估公司的新技术或新模式的独特性、领先程度和可实现度以及产品的市场独占性特征等。 在定量方面，主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值水平，选取具备良好业绩成长性并且估值合理的上市公司，主要采用的指标包括：成长性指标如过去两年和预计未来两年公司收入和利润的增长率等，盈利能力指标如毛利率、ROE、ROA等，估值水平指标如PE、PB、PS等。 3、港股通标的股票投资策略 基金管理人将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、境外机构投资者行为、境内机构和个人投资者行为、世界主要经济体经济前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等影响港股投资的主要因素来决定本基金对港股权重配置和个股选择。 本基金将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，采用“自下而上”精选个股策略，重点投资于新产业相关概念股票，其次投资受惠于中国经济转型、升级，且处于合理价位的具备核心竞争力股票。对上市公司
--	--

的发展速度和利润水平，也会被纳入到新兴产业的范围；最后，对于随着相关技术成熟，商业模式普及，行业竞争加剧，利润增速下降等而逐渐进入平稳运行期的原新兴产业相关行业，本基金将其剔除出新兴产业的投资范围。

B. 基金备选股票池的构建

在初选股票池的基础上，本基金管理人根据成长性、价值性指标对上市公司进行进一步筛选形成基金备选股票池，再根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”，精选出具有竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。

(1) 根据投资组合成长性的定量分析，形成基金备选股票池

① 成长性定量指标

本基金通过定性和定量相结合的方法来确定描述成长性的指标，定性的方法主要是研究国内外主要投资机构选择的成长性定量指标，结合国内的实际情况进行归纳总结，在此基础上，运用单因素分析，对各因素在国内市场的效果进行分析，找出最有效的指标。以下七个指标是本基金选取的衡量上市公司成长性的指标。

表 1：成长模块衡量成长性定量指标

EG	净利润增长率
REG	预期净利润增长率
RG	营业收入增长率
ROE	净资产收益率
EROE	预期净资产收益率
ROA	资产收益率
NAV	净资产增长率

② 根据成长性综合分值，形成基金备选股票池
按照以上七个成长性定量指标，对初步基金股票池中股票组合的过去三年，共三十六个月的历史数据进行分析。搜集组合中个股过去三十六个月的成长性指标数据，取各个成长性指标的数学平均值，将各项指标按等权重加权并相加汇总，得到个股成长性综合分值。

成长性综合指标 (GI) =
$$\frac{EG \times w_{EG} + REG \times w_{REG} + RG \times w_{RG} + ROE \times w_{ROE} + EROE \times w_{EROE} + ROA \times w_{ROA} + NAV \times w_{NAV}}{w_{EG} + w_{REG} + w_{RG} + w_{ROE} + w_{EROE} + w_{ROA} + w_{NAV}}$$

注： w_{EG} 、 w_{REG} 、 w_{RG} 、 w_{ROE} 、 w_{EROE} 、 w_{ROA} 、 w_{NAV}

分别代表各个指标的权重，在本基金选股时，以上七个指标的权重相等。

进行系统性分析，估值采用多种估值方法，包括 P/E（预期）、P/B、PCF、PFCF、相对于 NAV 的溢/折价、DDM、ROE，与历史、行业和市场的比较。

得到股票成长性指标(GI)分值之后,对GI分值进行排序,选择前80%的股票进入下一步筛选,其余股票剔除,形成基金备选股票池。

(2) 根据投资组合价值性的定量分析,形成基金备选股票池

在上述使用价值性指标筛选出的股票后,对这些股票进行价值评估,筛选过程的计算方法和步骤同成长性指标一样,也是分为两个部分:分别是确定描述价值的定量指标和计算股票价值分值。

① 价值性定量指标

同成长性指标研究方法一样,本基金仍然通过定性和定量相结合的方法来确定描述价值性的指标,最终,以下五个指标是本基金选取的衡量上市公司价值的指标。

表2: 价值模块衡量股票价值定量指标

PE	市盈率
PB	市净率
PS	市销率
PCF	市现率
EV/EBITDA	企业价值倍数

② 根据价值性综合分值,形成基金备选股票池
按照以上五个价值性定量指标,对初步基金股票池中股票组合的过去三年,共三十六个月的历史数据进行分析。搜集组合中个股过去三十六个月的价值性指标数据,取各个价值性指标的数学平均值,将各项指标按等权重加权并相加汇总,得到个股价值性综合分值。

价值性综合指标(VI)=

$$PE \times w_{PE} + PB \times w_{PB} + PS \times w_{PS} + PCF \times w_{PCF} + EV / EBITDA \times w_{EV / EBITDA}$$

注: w_{PE} 、 w_{PB} 、 w_{PS} 、 w_{PCF} 、 $w_{EV / EBITDA}$ 代

表各个指标的权重,在本基金选股时,以上五个指标的权重相等。

得到股票价值性指标(VI)分值之后,对VI分值进行排序,选择前80%的股票进入下一步筛选,其余股票剔除,形成基金备选股票池。

(3) 东吴基金企业竞争优势评价体系

形成基金备选股票池之后,本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”,计算备选股票池中上市公司的竞争优势综合分值,评价新兴产业上市公司的投资价值,精选出竞争优势综合分值排名靠前50%的上市公司股票作为基金

<u>股票池。</u> <u>2) 非新兴产业类上市公司选股策略</u> <u>非新兴产业类上市公司的可投资比例占股票资产的 20%，对于这一投资比例范围内的股票池构建适用东吴嘉禾基金的股票池。</u> <u>3) 股票池调整法则</u> <u>原则上，本基金根据上市公司发布定期报告对股票池进行相应调整。在宏观经济环境、行业基本面和市场指数发生重大变化情况下，可进行临时调整。同时，可根据行业研究员调研情况和研究成果，综合考虑上市公司的行业趋势、公司基本面、估值水平等方面的情况对本基金股票池内股票进行个别调进或调出。</u> <u>3、债券投资组合</u> 本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。 <u>1) 积极的流动性管理</u> <u>本基金会紧密关注央行对于流动性的调节以及市场的资金松紧，本基金的申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性管理框架，实现对基金资产的结构化管理，以确保基金资产的整体变现能力。</u> <u>2) 基于收益率预期的期限配置和类别配置</u> <u>在预期基准利率下降时，适当增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，同时获得比较高的利息收入；在预期基准利率上升时，缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险。</u> <u>3) 基于收益率曲线变形的调整策略</u> <u>在确定组合久期的情况下，预期收益曲线的变形调整债券组合的基本配置。当我们预期收益率曲线变陡时，我们将可能采用子弹策略；而当预期收益率曲线变平时，我们将可能采用杠铃策略，总体而言，就是在仔细评估收益曲线变形情况下，分别在子弹组合、梯式组合和杠铃组合中弹性选择。</u> <u>4) 基于相对利差分析调整信用产品配置</u> <u>观察金融债/国债，短期融资券/央票的相对利差调整组合的信用产品，在稳定的信用产品风险情况下，可在利差扩大时，适当增加信用产品比重；在利差缩小时，适当减持信用产品。</u> <u>4、权证投资策略</u>	<u>4、债券投资策略</u> 本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。<u>在债券投资方面，本基金采用多种投资策略，包括但不限于积极的流动性管理、基于收益率预期的期限配置和类别配置、基于收益率曲线变形的调整策略、基于相对利差分析调整信用产品配置等。</u>
---	--

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。<u>具体投资方法如下：</u> <u>1) 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。</u> <u>2) 根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。</u>	5、权证投资策略 本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。 6、资产支持证券投资策略 <u>本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</u>
(六) 投资限制 1. 组合限制 <u>本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。</u> 基金的投资组合将遵循以下限制： (1) 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%； (2) 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%； (3) 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%； (4) 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%； (5) 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%； <u>(6) 本基金股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于股票资产的 80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%；</u> (7) 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%； (8) 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%； (9) 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%；	(四) 投资限制 1. 组合限制 基金的投资组合将遵循以下限制： <u>(1) 本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中，对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%；本基金投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；</u> (2) 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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； <u>(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的，A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；</u> (4) 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%； (5) 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% <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> (6) 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%； (7) 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%；<u>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；</u>

(10) 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%； (11) 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； (12) 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； (13) 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) 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，其中一现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； (15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。 (16) 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%； (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该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合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。 <u>如果法律法规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。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</u>	(8) 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%； (9) 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%； (10) 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%； (11) 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%； (12) 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； (13) 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； (14) 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%； (15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险； <u>(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</u> (17) 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%； (18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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； <u>(19) 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</u>
--	--

除上述第(11)、(14)、(17)、(18)项之外，因证券市场波动、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。 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。 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) 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<u>国务院</u>另有规定的除外； (5) 向其基金管理人、基金托管人出资<u>或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券</u>； (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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； (7) 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； (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动； (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。	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； <u>(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</u> 除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项外，因证券市场波动、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，<u>但中国证监会规定的特殊情形除外。</u> 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>法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</u> 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) <u>违反规定</u>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<u>中国证监会</u>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。 <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</u>
---	---

	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。 如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。
(四) 业绩比较基准 基金业绩比较基准=75%*中证新兴产业指数+25%*中国债券综合全价指数 本基金股票投资比例为60%-95%，债券投资比例为0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，根据相关法律法规定义，本基金为混合型基金。因此，本基金总体业绩比较基准中，股票资产业绩比较基准给予了75%的权重，而债券资产业绩比较基准给予了25%的权重。本基金选择中证新兴产业指数作为股票资产业绩比较基准，中证新兴产业指数由中证指数公司正式发布，是目前市场上唯一一支以新兴产业为主题并横跨跨沪深两市的指数，并且该指数采用等权重方式加权计算，综合反映沪深市场中新兴科技和新兴产业深度融合的战略性新兴产业在证券市场的发展变化。因此，本基金股票资产业绩比较基准选择中证新兴产业指数。 中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为业绩比较基准。 如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况经与本基金托管	(五) 业绩比较基准 基金业绩比较基准为中证新兴产业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中国债券综合全价指数收益率*20% 中证新兴产业指数是选择沪深市中规模大、流动性好的100家新兴产业公司组成，以综合反映沪深市中新兴产业公司的整体表现。该指数采用等权重方式加权计算，综合反映沪深市场中新兴科技和新兴产业深度融合的战略性新兴产业在证券市场的发展变化。因此，本基金选择中证新兴产业指数作为股票资产中主题投资部分的业绩比较基准。 恒生综合指数涵盖香港联合交易所主板上市股份总市值约95%，是全面的香港市场指标，因此，本基金选择恒生综合指数收益率衡量港股通标的股票投资部分收益率。 中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为债券投资部分的业绩比较基准。 如果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，或者市场上出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适合用于本基金时，本基金管理人可在

	<u>人协商同意后调整本基金的业绩评价基准并报中国证监会备案，并及时公告。</u>	<u>与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。</u>
	(五) 风险收益特征 <u>本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。</u>	(六) 风险收益特征 <u>本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金除了投资于A股市场，还可以在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还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。</u>
	(七) 基金管理人代表基金行使<u>股东</u>权利的处理原则及方法 1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益； 2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理； 3. 有利于基金财产的安全与增值； 4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。	(七) 基金管理人代表基金行使<u>相关</u>权利的处理原则及方法 1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使<u>股东权利和其他相关</u>权利，保护基金份额持有人的利益； 2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理； 3. 有利于基金财产的安全与增值； 4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
	<u>(八) 基金的融资、融券</u> <u>本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。</u>	
十三、基金的财产	(三) 基金财产的账户 <u>本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册</u>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) 基金财产的处分 <u>基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。</u>基金管	(四) 基金财产的处分 <u>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、基金注册</u>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。

	理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。 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。 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。	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。
十四、基金资产估值	(一) 估值日 本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。	(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。
	(三) 估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。	(二) 估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
	(三) 估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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，按最近交易目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	(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) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。 (3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。 (4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。 3. 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资

<u>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。</u> <u>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。</u>	人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。 5. 本基金资产估值计算中涉及主要外币对人民币汇率的，应当以基金估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。 7. <u>当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
(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，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。<u>月末、年末和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</u>	(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，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 <u>基金管理人</u>每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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<u>按约定</u>对外公布。
(五) 估值错误的处理 1. 差错类型 本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或<u>代销</u>机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下： <u>(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。</u> <u>(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。</u>	(五) 估值错误的处理 1. 差错类型 本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或<u>销售</u>机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

	(六) 暂停估值的情形 <u>3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；</u> 5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。	(六) 暂停估值的情形 4. <u>法律法规或</u>中国证监会<u>规定</u>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开放日交易结束后计算当日的基金资产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<u>对基金净值予以公布</u>。	(七) 基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值<u>和基金份额净值</u>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<u>按约定</u>对基金净值予以公布。
	(八) 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<u>第5项</u>进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所<u>及</u>登记结算公司发送的数据错误，<u>或国家会计政策变更、市场规则变更等</u>，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。	(八) 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<u>第6项</u>进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、<u>证券经纪机构、</u>登记结算公司<u>等机构</u>发送的数据错误<u>等原因</u>，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、<u>基金托管人</u>应当积极采取必要的措施消除<u>或减轻</u>由此造成的影响。
	十五、基金费用和税收 (一) 基金费用的种类 3. 基金<u>财产划拨支付</u>的银行费用； 6. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所<u>和</u>律师费； 8. <u>依法</u>可以在基金财产中列支的其他费用。	(一) 基金费用的种类 3. 基金的银行<u>汇划</u>费用； 6. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所、<u>律师费、仲裁费和诉讼费</u>； 8. <u>账户开户费用、账户维护费</u>； 9. <u>因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用</u>； 10. <u>基金财产投资运营过程中的增值税</u>； 11. <u>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。</u>
	(三) 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 <u>在通常情况下</u>，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值	(三) 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 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5<u>0</u>% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。<u>由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</u> 2. 基金托管人的托管费 <u>在通常情况下</u>，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 基金托管费每日计提，按月支付。<u>由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</u>	基金管理费每日计提，按月支付。<u>由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。</u> 2. 基金托管人的托管费 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 基金托管费每日计提，按月支付。<u>由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。</u>
(四) 不列入基金费用的项目 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，<u>以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。</u>	(四) 不列入基金费用的项目 <u>下列费用不列入基金费用：</u> 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、<u>基金管理人和基金托管人</u>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。
<u>(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。</u>	
(六) 基金税收 <u>基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。</u>	(五) 基金税收 <u>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。</u> <u>鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务</u>

		<u>部门要求完成税款申报缴纳。</u>
十六、基金的收益分配	(五) 收益分配的时间和程序 1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订, 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上公告;	(五) 收益分配的时间和程序 1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订, 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上公告并报中国证监会备案;
十七、基金的会计和审计	(二) 基金的审计 1. 基金管理人聘请具有证券、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年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。 3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所, <u>经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。就更换会计师事务所, 基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</u>	(二) 基金的审计 1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。 3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所, <u>须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</u>
十八、基金的信息披露	(一) 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) 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及其日常机构等法律、行政法规和<u>中国证监会规定的自然人、法人和非法</u>人组织。 <u>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。</u> <u>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。</u> (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: (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;	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。<u>基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</u> 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。<u>基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。</u> 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: 4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额销售机构; 5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

(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。 (五)公开披露的基金信息包括： 1. 招募说明书 招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。 基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。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。 2. 基金合同、托管协议 基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。 3. 基金产品资料概要 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。 4. 基金份额发售公告 基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。 5. 基金合同生效公告 基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。 6. 基金净值信息 (1) 本基金的基金合同生效后，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	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<u>两种</u>文本的内容一致。<u>两种</u>文本发生歧义的，以中文文本为准。 公开披露的基金信息包括： <u>(一) 招募说明书</u> <u>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。</u> <u>基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</u> <u>(二) 基金合同、托管协议</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>(三) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告</u> <u>1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份</u>
---	--

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；— (2)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；— (3)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。— <u>7. 基金份额申购、赎回价格</u> 基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。— <u>8. 基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告</u> (1)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；— (2)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；— (3)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；— (4)基金合同生效不足 2 个月的，本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。— (5)如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。— (6)本基金持续运作过程中，基金管理人应当在	额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；— 2. 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；— 3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。 <u>(四) 基金份额申购、赎回价格公告</u> 基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。— <u>(五) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</u> 1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；— 2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；— 3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；— 4. 基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。— 5. 基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。— 6. 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。—
---	---

<u>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。</u> <u>9. 临时报告</u> <u>在基金运作过程中发生如下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事件时，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；</u> <u>(1)基金份额持有人大会的召开及决定的事项；</u> <u>(2)基金合同终止、基金清算；</u> <u>(3)转换基金运作方式、基金合并；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(6)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；</u> <u>(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；</u> <u>(8)基金募集期延长或提前结束募集；</u> <u>(9)基金管理人高级管理人员、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；</u> <u>(10)基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%，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 30%；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(14)基金收益分配事项；</u> <u>(15)管理费、托管费、申购费、赎回费等费用</u>	<u>7. 本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u> <u>(六) 临时报告</u> <u>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，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</u> <u>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：</u> <u>1. 基金份额持有人大会的召开；</u> <u>2. 终止基金合同；</u> <u>3. 转换基金运作方式；</u> <u>4. 更换基金管理人、基金托管人；</u> <u>5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；</u> <u>6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；</u> <u>7. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；</u> <u>8. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；</u> <u>9. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；</u> <u>10. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；</u> <u>11. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；</u> <u>12. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；</u> <u>13. 重大关联交易事项；</u> <u>14. 基金收益分配事项；</u> <u>15. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</u> <u>16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；</u> <u>17. 基金改聘会计师事务所；</u> <u>18. 基金变更、增加或减少销售机构；</u> <u>19. 基金更换注册登记机构；</u> <u>20. 本基金开始办理申购、赎回；</u> <u>21. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</u> <u>22. 本基金发生巨额赎回并延期办理；</u>
---	--

计提标准、计提方式和费率发生变更； (16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%； (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、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； (21) 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； (22) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。 10. 澄清公告 在本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。 11. 基金份额持有人大会决议 12. 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。 13. 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、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	23. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请； 24. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回； 25. 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 26. 基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 27. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。 (七) 澄清公告 在本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。 (八) 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。 (九) 本基金投资港股通标的股票，基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。 (十) 本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报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所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。 (十一) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。 (十二) 投资于非公开发行股票等流通受限证券的信息披露 基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。法律法规或监管部门另有规
---	--

	<u>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。</u> <u>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>(七)信息披露文件的存放与查阅</u> <u>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。</u> <u>(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。</u>	<u>定时，从其规定。</u> <u>(十三) 中国证监会规定的其他信息</u> <u>(十四) 信息披露文件的存放与查阅</u> <u>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</u> <u>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的规定。</u> <u>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、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者以双方认可的方式确认。</u> <u>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的媒介。</u> <u>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</u> <u>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》终止后十年。</u> <u>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。</u> <u>基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。</u>
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<u>(一) 基金合同的变更</u> <u>1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。</u> <u>(1) 转换基金运作方式；</u> <u>(2) 变更基金类别；</u> <u>(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；</u> <u>(4) 变更基金份额持有人大会程序；</u> <u>(5) 更换基金管理人、基金托管人；</u> <u>(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；</u>	<u>(一) 基金合同的变更</u> <u>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。</u>

(7)本基金与其他基金的合并； (8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项； (9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其 他情形。 <u>但出现下列情况时</u>，可不经基金份额持有人大会 决议，由基金管理人和基金托管人同意变更<u>后公 布</u>，并报中国证监会备案： (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基 金承担的费用； (2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变 更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费 方式； (3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合 同进行修改； (4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事 人权利义务关系发生重大变化； (5)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； (6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开 基金份额持有人大会的其他情形。 <u>2.关于变更基金合同的</u>基金份额持有人大会决 议<u>应报中国证监会核准或备案，并于中国证监 会核准或出具无异议意见后</u>生效执行，并自生效之 日起2日内在<u>至少一种</u>指定媒介公告。 (二)本基金合同的终止 有下列情形之一，本基金合同<u>经中国证监会核 准后</u>将终止： 4. 中国证监会规定的其他情况。	<u>2.关于《基金合同》变更的</u>基金份额持有人大会 决议生效<u>后方可执行</u>，并自<u>决议生效后</u>2日内在 指定媒介公告。 (二)本基金合同的终止 有下列情形之一，本基金合同将终止： 4. <u>法律法规</u>、中国证监会规定的其他情况。
(三)基金财产的清算 1. 基金财产清算组 (1)基金合同终止<u>时</u>，成立基金财产清算组，基 金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金 清算。 (2)基金财产清算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 财产清算组可以聘用必要的工作人员。 (3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、 估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进 行必要的民事活动。 2. 基金财产清算程序 <u>基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同 的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清</u>	(三)基金财产的清算 1. 基金财产清算<u>小组</u> (1)<u>自出现</u>基金合同终止<u>事由之日起30个工作日</u> 内成立基金财产清算<u>小组</u>，基金财产清算<u>小组</u>在 中国证监会的监督下进行基金清算。 (2)基金财产清算<u>小组</u>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<u>小组</u>可以聘用必要的工作人员。 (3)基金财产清算<u>小组</u>负责基金财产的保管、清 理、估价、变现和分配。基金财产清算<u>小组</u>可以 依法进行必要的民事活动。 2. 基金财产清算程序 <u>(1)基金合同终止情形出现时，由基金财产清 算小组统一接管基金财产；</u>

	<u>算程序主要包括：—</u> <u>(1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；—</u> <u>(2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；—</u> (3)对基金财产进行清理和确认； (4)对基金财产进行<u>估价</u>和变现； (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计； <u>(6)聘请律师事务所出具法律意见书；—</u> <u>(7)将基金财产清算结果报告中国证监会；—</u> <u>(8)参加与基金财产有关的民事诉讼；—</u> <u>(9)公布基金财产清算结果；—</u> <u>(10)对基金剩余财产进行分配。</u> 3. 清算费用 清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。 4. 基金财产按下列顺序清偿： (1)支付清算费用； (2)交纳所欠税款； (3)清偿基金债务； (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。 基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。 5. 基金财产清算的公告 <u>基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告，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；</u>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经<u>具有证券、期货相关业务资格的</u>会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，<u>由基金财产清算组</u>报中国证监会备案并公告。	(2)对基金财产<u>和债权债务</u>进行清理和确认； (3)对基金财产进行<u>估值</u>和变现； (4) <u>制作清算报告；—</u> (5)聘请会计师事务所对清算报告进行<u>外部</u>审计，<u>聘请律师事务所对清算报告</u>出具法律意见书； <u>(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；—</u> <u>(7)对基金剩余财产进行分配。</u> 3. 基金财产清算的期限为 6 个月，但若遇基金持有的有价证券出现长期休市、停牌或其他流通受限的情形除外。 4. 清算费用 清算费用是指基金财产清算<u>小组</u>在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算<u>小组</u>优先从基金<u>剩余</u>财产中支付。 5. 基金财产按下列顺序清偿： (1)支付清算费用； (2)交纳所欠税款； (3)清偿基金债务； (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。 基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。 6. 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；基金财产清算结果经会计师事务所审计<u>并由</u>律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。<u>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。</u>
二十、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》规定或者本基金合同约定，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。但是发生下列情况的，当事人可以免责：	(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》规定或者本基金合同约定，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。<u>对损失的赔偿，仅限于直接损失。</u>但是发生下列情况的，当

	1. 不可抗力； 2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等； 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其投资权而造成的损失等。 (二)基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当对直接损失承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。 (五)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、基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。	事人可以免责： 1. 不可抗力； 2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等； 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其投资权而造成的损失等。 (二)基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当对直接损失承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。 (五)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、基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人、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。
二十一、争议的处理和适用的法律	对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，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。 本基金合同受中国法律管辖。	对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。 争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。 本基金合同受中国法律管辖。
二十二、基金合同的效力	基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。 (一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 (三)本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 (一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 (三)本基金合同正本一式六份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持一份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律

效力。 (四) 本基金合同可印制成册, 供投资人在基金管理人、基金托管人、 代销机构和注册登记 机构办公场所查阅, 但其效力应以基金合同正本为准。	效力。 (四) 本基金合同可印制成册, 供投资人在基金管理人、基金托管人、 销售 机构办公场所查阅, 但其效力应以基金合同正本为准。
根据上述内容在“第二十四部分基金合同摘要”中相应修改和添加。	

(八) 授权基金管理人修改基金合同等法律文件

除上述内容的调整需要修改《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》以外, 考虑到自《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》生效以来, 《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施, 基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的东吴新产业精选股票型证券投资基金的产品特征修订《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》的相关内容。

综上所述, 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及转型后的东吴新产业精选股票型证券投资基金的产品特性相应修订《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》的内容。

(九) 《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》的生效

自本次基金份额持有人大会决议生效之日次日起, 由《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》生效, 原《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述, 拟请基金份额持有人大会授权基金管理人针对上述事项修订《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》, 基金管理人完成《东吴新产业精选混合型证券投资基金基金合同》修订并经基金托管人审核同意后, 将报中国证监会备案。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

(一) 东吴新产业精选混合型证券投资基金基本情况

东吴新产业精选股票型证券投资基金经中国证监会证监许可【2011】1021 号文核准募集, 自 2011 年 8 月 29 日起至 2011 年 9 月 23 日公开募集, 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, 《东吴新产业精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 28 日生效。基金管理人为东吴基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会于 2014 年 7 月 7 日颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》对基金类别的规定, 基金管理人将“东吴新产业精选股票型证券投资基金”变更为“东吴新

产业精选混合型证券投资基金”。

（二）东吴新产业精选混合型证券投资基金转型并召开基金份额持有人大会的必要性

从维护投资者利益的角度来看，为了优化基金的投资目标与投资策略，维护基金份额持有人利益，东吴新产业精选混合型证券投资基金转型为东吴新产业精选股票型证券投资基金，投资范围中增加了港股通标的股票，提高了产品的市场竞争力。

因此，东吴新产业精选混合型证券投资基金的转型将有利于帮助投资者参与资本市场，分享A股和香港市场资本市场成长果实，为投资者提供更多样化的理财产品。

（三）东吴新产业精选混合型证券投资基金转型的可行性

1、法律可行性

根据《基金合同》约定，可以通过召开基金份额持有人大会的方式，变更基金类别、基金投资目标、投资范围或投资策略以及对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求，基金份额持有人大会决议的一般决议，经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上通过方为有效。

因此，本基金《基金合同》的修改不存在法律方面的障碍。

2、技术运作可行性

本次对《基金合同》的修改主要是对基金的基金类别、投资范围进行了修改，基金管理人在股票型基金方面拥有多年投资、运营、风控经验，相关系统不存在技术操作上的障碍。

另外本次转型不涉及基金管理人、基金托管人和注册登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

（一）预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对转型方案进行适当修订，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。

如转型方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的转型方案议案。

（二）预防基金转型后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金转型后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人：东吴基金管理有限公司

联系电话：400-821-0588

传真：021-50509884

网站：www.scfund.com.cn

东吴基金管理有限公司

2020年11月24日