东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金
招募说明书更新

—东吴基金管理有限公司 2026 年 1 号

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

目 录

重要提示 1
一、绪言 2
二、释义 3
三、基金管理人 7
四、基金托管人 16
五、相关服务机构 20
六、基金的募集 22
七、基金合同的生效 23
八、基金的申购与赎回 24
九、与基金管理人管理的其他基金转换 32
十、基金的投资 34
十一、基金的业绩 42
十二、基金财产 45
十三、基金资产估值 46
十四、基金的收益分配 50
十五、基金费用与税收 51
十六、基金的会计与审计 53
十七、基金的信息披露 54
十八、侧袋机制 60
十九、基金的风险揭示 63
二十、基金的终止与清算 68
二十一、基金合同的内容摘要 70
二十二、基金托管协议的内容摘要 82
二十三、对基金份额持有人的服务 87
二十四、其他应披露事项 89
二十五、招募说明书存放及查阅方式 93
二十六、备查文件 94

重要提示

本基金根据 2004 年 11 月 25 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2004]201 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2005 年 2 月 1 日正式生效。

基金管理人保证《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

投资有风险，投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》及《基金合同》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本次招募说明书（更新）所载内容截止日为 2026 年 8 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）、其他有关规定及《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）编写。

本《招募说明书》阐述了东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人对未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人，其认购（或申购）基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》及其更新；
基金产品资料概要：	指《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《信息披露办法》	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》；
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》；
中国证监会或证监会：	指中国证券监督管理委员会；
《流动性风险规定》	指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》；
法律法规：	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；
基金合同当事人：	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体；
基金管理人：	指东吴基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）；
基金份额持有人：	指依照基金合同、招募说明书或更新后招募说明书摘要取得和持有本基金份额的基金投资者；
注册登记业务：	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理基金注册登记业务的机构；

基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的，用以记录各自持有的基金份额余额及其变动情况的账户；
直销机构：	指东吴基金管理有限公司；
代销机构：	指符合中国证监会和中国银监会有关规定，并与基金管理人签订了销售代理协议，代为办理销售服务业务的机构；
销售机构：	指直销机构和代销机构；
个人投资者：	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构；
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办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者；
基金投资者或投资者：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者；
元：	指人民币元；
募集期：	指自基金份额发售之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过3个月；
存续期：	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间；
基金合同生效日：	指基金达到法律规定及基金合同规定的条件下，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续后，基金合同生效的日期；
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指销售机构为投资者办理申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指销售机构受理投资者业务申请的工作日；
T + N日：	指自T日起第N个工作日（不包含T日）；
认购：	指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为；
申购：	指在本基金存续期间，投资者申请购买本基金份额的行为；
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回基金份额的行为；
巨额赎回：	单个开放日针对基金的净赎回申请超过上一日该基金总份额的10％时，为该基金的巨额赎回。单个开放日的净赎回申请，是指该基金份额的赎回申请加上基金转换中该基金的转出申请，再扣除当日发生的该基金份额申购申请及基金转换中该基金的转入申请之和后得到的余额；

基金转换：	指在基金存续期间，基金份额持有人向基金管理人提出申请，将其持有的基金份额转换为该基金管理人管理的另一只基金的基金份额；
基金份额：	指向不特定的投资者发行的，表示持有人对基金享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利，并承担相应义务的凭证；
基金份额发售公告：	指《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金份额发售公告》；
基金收益：	基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其它收入；
基金资产总值：	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；
基金资产净值：	基金资产总值减去其总负债后的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产与负债的价值，用以确定基金资产净值和收益的过程；
销售服务费：	指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用；
A类基金份额：	指在投资人申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别；
C类基金份额：	指在投资人申购时不收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别；
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；
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；
侧袋机制：	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保

	投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户；
特定资产：	包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产；
不可抗力：	指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行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、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。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：李素明

设立日期：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 亿元人民币

联系人：谢玉婷

电话：（021）50509888

传真：（021）50509884

客户服务电话：400－821－0588（免长途话费）、021-50509666

公司网址：www.scfund.com.cn

股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

薛臻先生，董事长，硕士研究生，中共党员。历任苏州市农村干部学院教师、团总支书记、培训处副处长、干部培训处处长、办公室主任、院长助理兼科研开发处处长、副院长、纪委书记；苏州创元投资发展（集团）有限公司党委副书记、工会主席；苏州资产管理有限公司总裁、党委副书记、党委书记、董事长。现任东吴证券股份有限公司党委副书记、总裁，东吴基金管理有限公司董事长。

李素明先生，董事，博士。历任重庆国际信托投资公司北京营业部副总经理、总经理；西南证券股份有限公司总裁助理、董秘、稽核总监；红塔证券股份有限公司董事会秘书、副总裁、常务副总裁、总裁；重庆鸿业百泰私募股权投资基金管理有限公司董事长，现任东吴基金管理有限公司总经理兼财务负责人。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），东吴证券人力资源部总经理，现任东吴证券党委组织部部长、东吴证券人力资源总监兼人力资源部总经理。

郭晶晶女士，董事，硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司销售经理，光大证券研究所销售经理，深圳明达资产管理公司营销总监，国金证券研究所区域销售总监，招商证券北京基金业务总监，东吴证券研究所销售总监（董事总经理）、副所长（主持工作）。现任东吴证券研究所行政负责人。

张戈先生，董事，本科，中共党员。历任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

袁建新先生，独立董事，博士研究生，中共党员。历任苏州大学政治与公共管理学院讲师、副教授、系主任，苏州大学商学院教授、系主任、副院长等职务。袁建新先生现担任江苏东方盛虹股份有限公司独立董事、苏州市建筑科学研究院集团股份有限公司独立董事和苏州轴承厂股份有限公司独立董事。

宋亚辉先生，独立董事，博士研究生，中共党员。历任东南大学法学院讲师、南京大学法学院副教授，现任南京大学法学院教授，兼任南京全信传输股份有限公司独立董事。

叶辉先生，独立董事，中级会计师。历任贵阳粑粑坳粮食仓库会计、贵阳亚兴会计师事务所项目经理、上海景天华联合会计师事务所部门经理、瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所高级经理、天健会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所高级经理，现任上会会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人，兼任上海潇逸企业管理咨询有限公司监事、西藏智汇矿业股份有限公司独立董事。

2、高管人员

李素明先生，总经理兼财务负责人，博士，中共党员。历任重庆国际信托投资公司北京营业部副总经理、总经理；西南证券股份有限公司总裁助理、董秘、稽核总监；红塔证券股份有限公司董事会秘书、副总裁、常务副总裁、总裁；重庆鸿业百泰私募股权投资基金管理有限公司董事长，现任东吴基金管理有限公司总经理兼财务负责人。

葛锋先生，常务副总经理，硕士。历任浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司营销培训生；博时基金管理有限公司高级区域经理、区域总监、杭州营销中心副总经理（主持工作）、

杭州营销中心总经理、零售-中部负责人；永赢基金管理有限公司渠道业务总部总经理；信达澳亚基金管理有限公司首席市场官；现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

黄漫先生，副总经理，硕士。历任红塔证券创新研究部金融工程师、副总经理、副总经理（主持工作）；红塔证券子公司红正均方投资有限公司总经理；红塔证券投资管理总部从事投资工作；红塔证券固定收益总部副总经理；红塔证券上海固定收益分公司副总经理（主持工作）、副总经理；现任东吴基金管理有限公司副总经理。

夏志凡先生，副总经理，本科，中共党员。历任中国平安人寿保险总部人力资源部绩效管理岗；阳光人寿保险总部人力资源部主管；平安国际融资租赁有限公司人力资源部经理；财通证券资产管理有限公司人力资源部总经理兼综合办公室主任；永赢基金管理有限公司人力资源部总经理；东吴证券股份有限公司人力资源部副总经理；现任东吴基金管理有限公司副总经理。

刘婷婷女士，督察长，硕士，中共党员。历任南京永华会计师事务所审计员、会计师；中国证监会南京特派办上市公司监管处科员、副主任科员；中国证监会江苏监管局上市公司监管二处主任科员、副处长、调研员；中国证监会江苏监管局机构监管处、机构检查处二级调研员。现任东吴基金管理有限公司督察长。

葛艳女士，首席信息官，硕士。历任东吴证券有限责任公司信息技术经理，东吴基金管理有限公司信息技术部总经理，现任东吴基金管理有限公司首席信息官。

3、基金经理

刘元海先生，中国国籍，同济大学管理学博士，具备证券投资基金从业资格。曾任职东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总经理（2004 年 2 月-2015 年 6 月），期间担任东吴新产业精选股票型证券投资基金、东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）、东吴内需增长混合型证券投资基金、东吴行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月再次加入东吴基金管理有限公司，现任首席投资官、基金经理。2017 年 2 月 9 日至 2020 年 1 月 9 日担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理，2020 年 1 月 18 日至 2021 年 3 月 1 日担任东吴新经济混合型证券投资基金基金经理，2020 年 4 月 1 日至 2022 年 12 月 30 日担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月 27 日至今担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 4 月 29 日至今担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022 年 1 月 25 日至今担任东吴新能源汽车股票型证券投资基金基金经理，2023 年 8 月 15 日至今担任东吴

嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理,2024 年 8 月 20 日至今担任东吴科技创新混合型证券投资基金基金经理，2026 年 6 月 30 日至今担任东吴产业趋势混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理

向朝勇，2005 年 02 月 01 日至 2006 年 10 月 10 日

庞良永，2006 年 10 月 10 日至 2008 年 05 月 27 日

魏立波，2008 年 01 月 08 日至 2010 年 01 月 06 日

唐祝益，2009 年 12 月 24 日至 2012 年 10 月 27 日

邹国英，2012 年 10 月 27 日至 2014 年 06 月 14 日

程　涛，2013 年 08 月 01 日至 2015 年 02 月 06 日

王立立，2013 年 12 月 23 日至 2018 年 02 月 27 日

曹松涛，2017 年 04 月 14 日至 2019 年 05 月 13 日

彭　敢，2017 年 07 月 14 日至 2021 年 03 月 01 日

胡启聪，2019 年 06 月 21 日至 2021 年 08 月 21 日

邬　炜，2021 年 03 月 01 日至 2023 年 08 月 15 日

4、投资决策委员会成员

投资决策委员会：总经理兼财务负责人李素明、副总经理黄漫、首席投资官刘元海、专户投资总部副总经理徐骁天、权益投资总部权益研究部联席总经理谭菁、权益投资总部权益研究部联席总经理辜岚、权益投资总部总经理刘瑞、固定收益总部副总经理（主持工作）兼固收投资部总经理杜澄楷、固定收益总部总经理助理兼固收研究部总经理陈习龙。刘元海任投资决策委员会主任，王晓彤为投资决策委员会秘书。

5、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、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;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议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；

2、办理基金备案手续；

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

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管

理和运作基金财产；

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

11、严格按照《基金法》《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决定；

26、建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、基金管理人严格遵守《证券法》《基金法》《信息披露办法》《运作办法》《销售办法》，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》及有关法规禁止的行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）承销证券；

（6）向他人贷款或者提供担保；

（7）从事承担无限责任的投资；

（8）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（9）向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（10）买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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；

（11）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；

（12）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

3、基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金合同当事人的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

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

（9）在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（10）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

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

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

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

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

2、内部控制的制度体系

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括合规管理制度、风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理和业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

3、内部控制的主要内容

①控制环境

公司牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，确保内控机制的建立、完善和各项管理制度的执行。

公司设立董事会，董事会下设的风险控制委员会和审计委员会，全面负责公司的风险管理和风险控制，对公司经营的合法性、合规性进行检查。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。在总经理领导下，设立了投资决策委员会、风险管理委员会等，负责制定各类风险防范和管理措施并执行。

公司设督察长，由董事会聘任，直接对董事会负责，按照中国证监会的规定和董事会的授权进行工作，负责组织指导公司监察稽核工作。

②风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

③控制活动

公司各岗位职责明确，并建立了适当的授权制度，各业务部门、分支机构和公司员工在规定授权范围内行使相应的职责。公司建立了科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。公司建立了完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

④信息与沟通

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

⑤内部控制监督

公司对内部控制的执行情况和内部控制的有效性及适应性等进行持续的、定期的监督评估。内部控制的监督评估由公司风险管理委员会、督察长和独立的合规风控部等部门根据各自的职权范围进行。必要时，公司可聘请外部专家就公司内部控制进行检查和评价，并出具专题报告。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（2）公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人： 廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2026 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 209 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2026 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1577 只。自 2003 年以来，本行连续二十二年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 113 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制 COSO 准则从控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从 2005 年至今，中国工商银行资产托管部共十九次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

1.内部控制目标

（1）资产托管业务经营管理合法合规；

（2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；

（3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；

（4）提高资产托管经营效率和效果；

（5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

2.内部控制的原则

（1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。

（2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

（3）制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

（4）适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

（5）审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机

构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

（6）成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

3.内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

（1）总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

（2）总行内控合规部负责托管业务的内控管理工作再监督，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中。

（3）总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

（4）一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

4.内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在制度、流程、岗位、系统、授权审批、新机构、新客户、新业务及新产品、合同、印章、利益冲突、反洗钱、业务连续性等全方面执行内部控制措施。

5.风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理与内部控制委员

会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险、次生风险和道德风险。

6.业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异城相结合的备份办公场所、必要的工作人员、科学清晰的 AB 岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异城异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：李素明

联系人：谢玉婷

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：www.scfund.com.cn

2、其他销售机构：

其他销售机构情况详见基金份额发售公告及基金管理人网站或相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。

3、基金管理人可根据《基金法》《运作办法》《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）注册登记机构：东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：李素明

联系人：谢玉婷

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：4008210588

网站：www.scfund.com.cn

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：陈臻

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

法定代表人：邹俊

经办注册会计师：黄小熠

电话：021 2212 2888

传真：021 6288 1889

六、基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》《运作办法》《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集申请经中国证监会证监许可[2004]201 号文核准。

（一）基金类别

混合型

（二）基金运作方式

契约型开放式

（三）基金存续期限

不定期

（四）募集对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）及合格境外机构投资者。

（五）募集方式

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

（六）募集情况

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证监会证监许可[2004]201 号文批准，自 2004 年 12 月 20 日起向社会公开募集。截止到 2005 年 01 月 25 日，基金募集工作已顺利结束。

经安永大华会计师事务所验资，本基金有效认购户数为 6，388 户；本次募集的净认购金额为 1,029,255,913.38 元人民币，折合基金 1,029，255,913.38 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 204,372.99 元，其中 96,927.57 元折算为基金份额归基金份额持有人所有，其余利息作为其他基金资产归基金所有，确认基金份额总计 1,029,352，840.95 份。实收基金及其他基金资产共计 1,029,460,286.37 元。上述资金已于 2005 年 01 月 28 日划入本基金在基金托管人中国工商银行开立的东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金托管专户。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件

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《东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，东吴基金管理有限公司已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2005 年 02 月 01 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

《基金合同》生效时，认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。

(二)基金合同无法按期满足生效条件的处理

如果《基金合同》不能生效，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 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

如果《基金合同》不能生效，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。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《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 5,000 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。

八、基金的申购与赎回

(一)申购和赎回的场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点进行。投资者可按销售机构提供的交易方式办理基金的申购和赎回。销售代理人或销售代理人的代销网点如有变动，基金管理人将在管理人网站公示。

（二）申购和赎回的办理时间

1、开放日及时间

本基金开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。基金合同生效以后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理该类基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购的开始日及业务办理时间

本基金自合同生效日后不超过 3 个月的时间起开始办理申购。具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

3、赎回的开始日及业务办理时间

本基金自合同生效日后不超过 3 个月的时间起开始办理赎回。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于开始日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介上公告。

（三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤消；

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登公告。

（四）申购和赎回限制

本基金的单笔最低申购（含定期定额投资）金额为 1.00 元（含申购费，A 类份额与 C 类份额分别计算，下同），追加申购单笔最低限额为 1.00 元（含申购费）；本基金的单笔最低赎回份额、最低转换转出份额为 1 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构托管的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次性全部赎回；本基金的最低持有份额相应为 1 份。

销售机构可自行设置相关基金的单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低赎回份额、最低转换转出份额、最低持有份额，但不得低于本公司设定的上述业务的最低数额限制。投资者通过各销售机构办理基金投资业务需遵循各销售机构的具体规定，敬请投资者留意。

投资者通过本公司直销渠道办理上述基金的投资业务，单笔最低申购（含定期定额投资）金额（含申购费）、追加申购单笔最低限额为 10.00 元（含申购费）；单笔最低赎回份额、最低转换转出份额、最低持有份额为 10 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在直销渠道托管的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次性全部赎回。

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

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）申购和赎回的程序

1、申请方式

基金投资者必须根据基金销售网点规定的手续，在开放日的营业时间内向基金销售网点提出申购或赎回的申请。申请方式为书面申请或基金销售网点规定的其他方式。

投资者在申购基金时须按基金销售网点规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购与赎回的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册与过户登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其它方式查询申购与赎回的成交情况。

3、申购与赎回款项支付的方式与时间

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，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本《基金合同》的有关条款处理。

（六）申购与赎回的数额和价格

1、申购数额、余额的处理方式

（1）投资者按金额申购基金，基金申购份额计量单位为份，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此引起的差额计入基金资产。

（2）投资者赎回时按份额赎回基金，赎回金额计量单位为人民币元，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此引起的差额计入基金资产。

2、基金的申购费和赎回费

（1）A 类基金份额的申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取基金前端申购费用；C 类基金份额不收取申购费用。

申购金额(M)	A 类基金份额申购费率
M＜100 万	1.50%
100 万≤M＜500 万	1.20%
500 万≤M＜1000 万	0.80%
M≥1000 万	1000 元/笔

（2）赎回费用

赎回费按投资者持有的时间分段收费。

对于本基金 A 类基金份额，赎回费率如下：

持有时间 T	A 类基金份额赎回费率
T＜7 天	1.50%
7 天≤T＜1 年	0.50%
1 年≤T＜2 年	0.25%
T≥2 年	0.00%

注：1 年指 365 日

对于本基金 C 类基金份额，赎回费率如下：

持有时间 T	C 类基金份额赎回费率
T<7 日	1.50%

7 日≤T<30 日	0.50%
T≥30 日	0%

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

（4）赎回费用由赎回人承担，除了作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费以外，赎回费的至少 25%归入基金资产，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。C 类基金份额的赎回费用全额计入基金财产。

（5）基金管理人可以根据情况调低申购费率和赎回费率，调低申购费率、赎回费率不须召开份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种中国证监会指定媒介上刊登公告。

3、申购份数与赎回金额的计算方式

（1）基金申购份额的计算

1）A 类基金份额的申购

A 类基金份额的申购份额为净申购金额除以以当日的 A 类基金份额净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，计算结果保留小数点后两位，第三位四舍五入。

A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

①申购费用适用比例费率的情形下：

申购费用＝申购金额×申购费率

净申购金额＝申购金额—申购费用

申购份额＝净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

②申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-固定金额

申购份额=净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

2）C 类基金份额的申购

C 类基金份额的申购份额为申购金额除以当日的 C 类基金份额净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，计算结果保留小数点后两位，第三位四舍五入。

申购份额=申购金额/T 日 C 类基金份额净值

（2）基金赎回金额的计算

赎回金额为赎回总额扣减赎回费用后的余额，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

赎回总额＝赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额-赎回费用

4、基金份额净值的计算方式

各类基金份额净值为计算日各类基金资产净值除以计算日发行在外的各类基金份额总数，各类基金份额净值单位为元,计算结果保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

T 日各类基金份额净值= T 日各类基金资产净值/ T 日发行在外的各类基金份额总数。

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（七）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登公告。

（八）拒绝接受或暂停接受申购和赎回申请的情况

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）基金资产规模过大，使本基金管理人无法找到合适的投资机会，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（2）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（3）证券交易所交易时间非正常停市；

（4）法律法规规定或经中国证监会批准的其他暂停申购情形；

（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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

（6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；

（7）本基金管理人认为会影响其他基金份额持有人利益的申购申请。

上述（1）到（5）项为暂停申购情形，发生时本基金管理人立即在指定媒介上刊登暂停申购公告；

上述（5）项为拒绝申购情形，发生时申购款项将全额退还基金投资者。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

（1）根据有关法律、法规、中国证监会的规定、本基金合同及基金管理人的业务规则，拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；

（2）拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；

（3）按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、暂停赎回的条件

本基金管理人应当按时支付赎回款项，但是下列情形除外：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

（4）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；

（5）法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

第（1）项规定的情形消失后，本基金管理人应当及时支付赎回款项。

发生上述情形之一的，本基金管理人应当在当日报国务院证券监督管理机构备案。已接受的申请，本基金管理人应足额兑付；如暂时不能足额兑付，可兑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，未兑付部分由本基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以该开放日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但本基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受基金投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

5、在暂停的情况消除时，本基金管理人应及时恢复办理申购或赎回业务。暂停期间结束，基金重新开放时，本基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天，本基金管理人将于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，本基金管理人将提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，本基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，本基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的

信息披露媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

（九）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日净赎回申请超过基金总份额的 10％的，为巨额赎回。

本基金发生巨额赎回的，基金管理人当日办理的赎回份额不得低于基金总份额的 10%，对其余赎回申请可以延期办理。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

⑴全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

⑵部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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基金总份额的 10％的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。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；投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤消。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的该类基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（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）部分顺延延期赎回”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。

（4）当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在两日内通过指定媒介、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，或邮寄、传真等方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

（5）本基金连续发生巨额赎回，基金管理人可按基金合同的约定和招募说明书的规定，暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定报刊及其他相关媒介上予以公告。

（十）单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 5%的，基金管理人可以按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定暂停接受赎回申请或者延缓支付。

（十一）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或届时发布的相关公告。

九、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换业务的适用范围

基金管理人将根据具体情况确定基金转换业务的适用范围，并将另行公告。

（二）适用销售机构

根据业务需要，本基金管理人将选择适用销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

（三）业务办理时间

基金办理转换业务的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停转换时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。

（四）基金转换业务规则

1、基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额；

2、基金转换只能转换为基金管理人管理的、同一注册登记人登记存管的、同一基金账户下的基金份额，并只能在同一销售机构进行，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售；

3、拟转出的基金必须处于可赎回状态，拟转入的基金必须处于可申购状态；

4、目前只开通前端收费模式下进行基金转换，而不能将前端收费基金份额转换为后端收费基金份额，或将后端收费基金份额转换为前端收费基金份额。如今后开通后端收费模式基金的转换业务，具体转换业务规则以相关公告内容为准；

5、基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后 2 位，单笔转换申请份额不得低于 1 份。

6、对于基金分红时，权益登记日申请转换转出的基金份额享有该次分红权益，权益登记日申请转换转入的基金份额不享有该次分红权益；

7、基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额净值为基准进行计算；

8、转换业务遵循“先进先出”的业务规则，先确认的认购或者申购的基金份额在转换时先转换；

9、单个开放日基金净赎回份额及净转换转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

10、转入基金的持有时间将重新计算，与转出基金的持有时间无关；

11、投资者在Ｔ日办理的基金转换申请，基金注册登记机构在Ｔ＋１日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在Ｔ＋２日后（包括该日）投资者可通过基金份额发售机构或以基金份额发售机构规定的其他方式查询成交情况；

12、基金转换费用由基金持有人承担；

13、基金管理人将根据今后发行的其他开放式基金的具体情况对本业务规则进行补充和调整。

（五）基金转换费及份额计算方法

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转换公式如下：

（1）转出金额＝转出基金份额×转出基金Ｔ日该类基金份额净值（此处的Ｔ日指基金转换申请日，下同）

（2）转出赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率（注：转出赎回费的 25％将归入转出方基金的基金财产）

（3）转入金额＝转出金额－转出赎回费

（4）如果，转出基金的申购费率＜转入基金的申购费率，

申购补差费率＝转入基金的申购费率－转出基金的申购费率

申购补差费＝转入金额×申购补差费率／（1＋申购补差费率）

转入净额＝转入金额－申购补差费

如果，转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率，

转入净额＝转入金额

（5）转入份额＝转入净额÷转入基金Ｔ日该类基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。

2、转出金额、转出基金转换费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转出基金资产中列支；转入份额、申购补差费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转入基金资产中列支。

3、对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

4、计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过基金管理人网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照基金管理人最新公告的相关费率计算基金转换费用。

十、基金的投资

（一）投资目标

分享中国经济成长，以中低风险水平获得中长期较高收益。

本基金通过个股精选、科学的操作策略及严密的风险控制等手段来降低投资风险，力争将本基金的风险水平控制在比较基准的一定幅度范围内；同时，本基金通过对中国经济成长规律的准确把握和对具有价值成长比较优势股票的前瞻性投资来分享中国经济成长，获得中长期较高收益。

（二）投资方向

本基金投资范围为法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。具体比例范围为：30%-95%的基金资产投资股票，投资债券资产不高于基金资产的 60%，现金类资产最低比例为 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。基金股票资产的 80%以上投资于三重比较优势选股模型选出的股票。

（三）投资策略

1、资产配置策略：平衡风险收益、把握优势成长

通过评估各细分市场的风险收益水平，再根据本基金的风险收益目标动态调整股票、债券及现金类资产的配置比例。在配置顺序上股票优先，其次债券。在股票资产配置上以优势行业和优势企业为主。

2、股票选择策略：三重比较优势选股模型选股

本基金通过行业、企业及价格比较优势选股模型对个股在行业、企业及价格三方面比较优势的分析筛选来构建本基金的股票池。

具体过程为：首先根据东吴优势行业综合评价模型对所有行业进行分析排名，按排名结果将所有行业划分为东吴优势行业、一般行业和弱势行业。其次，根据东吴企业竞争优势综合评价模型构建东吴股票初选库（Ⅰ）；根据东吴 EVA 价格比较优势选股模型构建东吴股票初选库（Ⅱ）。第三，取初选库（Ⅰ）和初选库（Ⅱ）交集中属于东吴优势行业部分的股票作为本基金股票池的主要备选股票库；取（Ⅰ）和（Ⅱ）交集中不属于东吴优势行业部分的股票作为本基金股票池的补充备选股票库。最后，主要备选股票库和补充备选股票库经过流动性优化后共同构成本基金最终股票池。

3、股票操作策略：周期持有、波段操作

本基金将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在最具成长优势的时间段上中长期周期持有证券资产，同时根据指数及个股运行的时空和价量效应在最有利的时点上进行中短期波段操作。

4、债券投资策略

本基金在债券品种选择上，遵循相对价值原则和流动性原则。相对价值原则指选择到期收益率处于收益率曲线上方的个券，在到期收益率接近的券种之间，选择久期较短者，在久期接近的券种之间，选择凸性较大者；流动性原则指选择交易活跃的现券，用换手率或周转率指标来衡量。

本基金对债券资产品种配置的依据为不同品种之间的风险收益水平，配置方法根据利率变动情况分别考虑杠铃型、纺锤型等组合方法，同时考虑动态控制和调整组合的久期；可转债品种配置将综合考虑市场容量、条款对价格的影响等因素。

5、现金管理策略

充分利用交易所市场与银行间市场的无风险投资机会，提高现金使用效率。

（四）业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准=65%*（60%*上证 180+40%*深证 100）+35%*中证全债指数。

（五）风险收益特征

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与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。

销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。

（六）投资程序

1、投资决策

由投资决策委员会决策基金总体战略、资产配置方案，审议股票池，对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策，就风险事项与风险管理委员会沟通。

2、研究支持

由研究策划部为主构建基金股票池，为投资决策委员会提供投资决策咨询支持，为基金经理投资提供研究支持。其中，金融工程小组将专门对基金经理拟构建组合的行业、个股和个券进行收益与风险分析。

3、组合构建

由基金经理在研究策划部支持下，根据自己对市场的分析、研究与判断提出仓位计划和组合预案，并经投资决策委员会审议批准后具体实施。

4、交易执行

由集中交易室执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合法合规性。

5、绩效评估

由金融工程小组对投资组合的执行情况进行跟踪与评估，具体内容包括业绩归因分析、风险归因分析以及风险收益配比分析等方面。分析结果与本基金比较基准及国内同类基金风险收益水平进行比较，寻找其中的差异，作为基金经理优化组合管理的重要参考。

6、风险控制

由风险管理委员会、合规风控部等构成基金投资风险管理的专门机构，以识别、防范和控制基金投资各个环节的风险。监察稽核部对投资决策及实际投资进行全程监控，并定期和不定期向风险管理委员会提供风险事项报告；风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策委员会沟通，以监控投资决策流程和各级决策权限的行使是否合法合规及科学合理。

（七）投资限制

基金管理人将依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

1、本基金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）本基金参与股票发行申购所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；

（4）现金类资产最低比例为 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

（6）本基金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；

（7）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；

（8）遵守中国证监会规定的其他比例限制；

（9）除上述第（4）、（6）、（7）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述比例，基金管理人应当在十个交易日内进行调整并使之比例符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

2、禁止用本基金资产从事以下行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保、抵押；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）从事房地产等实业投资；

（5）买卖其它基金份额，但是国务院另行规定的除外；

（6）向基金管理人、基金托管人出资或买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

（7）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或与基金管理人、基金托管人有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

（8）从事内幕交易、操作证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（9）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他禁止行为。

（八）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则和方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营；

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

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

4、有利于基金资产的安全与增值。

（十）基金投资组合报告

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2026 年 6 月 30 日（未经审计）

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,310,706,210.04	90.37
	其中：股票	1,310,706,210.04	90.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,271,823.73	7.67
8	其他资产	28,361,018.20	1.96
9	合计	1,450,339,051.97	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,229,053,826.58	88.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,650,800.00	5.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,310,706,210.04	93.87

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	236,200	143,373,400.00	10.27
2	002475	立讯精密	1,900,000	133,760,000.00	9.58
3	300308	中际旭创	105,000	133,350,000.00	9.55
4	603986	兆易创新	155,000	126,325,000.00	9.05
5	601138	工业富联	1,700,000	122,655,000.00	8.78
6	002463	沪电股份	800,000	122,240,000.00	8.75
7	300476	胜宏科技	320,000	110,857,600.00	7.94
8	002273	水晶光电	3,100,000	109,988,000.00	7.88
9	688981	中芯国际	550,000	87,351,000.00	6.26
10	688521	芯原股份	220,000	81,650,800.00	5.85

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中“立讯精密（证券代码：002475）”的发行主体在报告编制日前一年内受到监管部门的处罚。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	610,547.90

2	应收证券清算款	14,027,287.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,723,182.55
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	28,361,018.20

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩

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资产,但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）东吴嘉禾优势精选基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

东吴嘉禾优势精选混合 A

时间	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005.02.01-2005.12.31	-7.47%	0.90%	1.25%	0.89%	-8.72%	0.01%
2006.01.01-2006.12.31	128.15%	1.29%	81.40%	0.92%	46.75%	0.37%
2007.01.01-2007.12.31	99.33%	1.93%	106.00%	1.51%	-6.67%	0.42%
2008.01.01-2008.12.31	-46.85%	1.94%	-38.91%	1.96%	-7.94%	-0.02%
2009.01.01-2009.12.31	39.00%	1.34%	65.79%	1.35%	-26.79%	-0.01%
2010.01.01-2010.12.31	17.88%	1.45%	-6.41%	1.05%	24.29%	0.40%
2011.01.01-2011.12.31	-23.99%	1.18%	-15.58%	0.87%	-8.41%	0.31%
2012.01.01-2012.12.31	2.42%	1.07%	6.48%	0.86%	-4.06%	0.21%
2013.01.01-2013.12.31	0.70%	1.67%	-3.85%	0.92%	4.55%	0.75%
2014.01.01-2014.12.31	7.52%	1.33%	35.55%	0.80%	-28.03%	0.53%
2015.01.01-2015.12.31	19.10%	3.31%	8.25%	1.61%	10.85%	1.70%
2016.01.01-2016.12.31	-8.18%	2.16%	-6.99%	0.94%	-1.19%	1.22%
2017.01.01-2017.12.31	5.48%	0.95%	14.95%	0.43%	-9.47%	0.52%
2018.01.01-2018.12.31	-27.44%	1.50%	-13.96%	0.88%	-13.48%	0.62%
2019.01.01-2019.12.31	27.54%	1.22%	28.64%	0.83%	-1.10%	0.39%
2020.01.01-2020.12.31	46.59%	1.76%	22.43%	0.93%	24.16%	0.83%
2021.01.01-2021.12.31	-14.27%	1.57%	0.32%	0.79%	-14.59%	0.78%
2022.01.01-2022.12.31	-27.17%	1.27%	-12.95%	0.84%	-14.22%	0.43%
2023.01.01-2023.12.31	7.19%	2.04%	-6.33%	0.56%	13.52%	1.48%
2024.01.01-2024.12.31	36.27%	2.41%	13.83%	0.89%	22.44%	1.52%
2025.01.01-2025.12.31	87.23%	2.23%	13.55%	0.66%	73.68%	1.57%
2026.01.01-2026.06.30	44.92%	2.29%	6.98%	0.77%	37.94%	1.52%
2005.02.01-2026.06.30	1,096.24%	1.76%	441.07%	1.04%	655.17%	0.72%

东吴嘉禾优势精选混合 C

时间	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022.02.22-2022.12.31	-19.78%	1.30%	-9.50%	0.86%	-10.28%	0.44%

2023.01.01-2023.12.31	6.76%	2.04%	-6.33%	0.56%	13.09%	1.48%
2024.01.01-2024.12.31	35.74%	2.41%	13.83%	0.89%	21.91%	1.52%
2025.01.01-2025.12.31	86.50%	2.23%	13.55%	0.66%	72.95%	1.57%
2026.01.01-2026.06.30	44.83%	2.29%	6.98%	0.77%	37.85%	1.52%
2022.02.22-2026.06.30	214.00%	2.09%	17.23%	0.75%	196.77%	1.34%

注：1、业绩比较基准=65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中证全债指数。

2、本基金于 2022 年 2 月 22 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

3、本基金业绩比较基准收益率于 2021 年 4 季度起采用单日收益率加权方式进行计算。

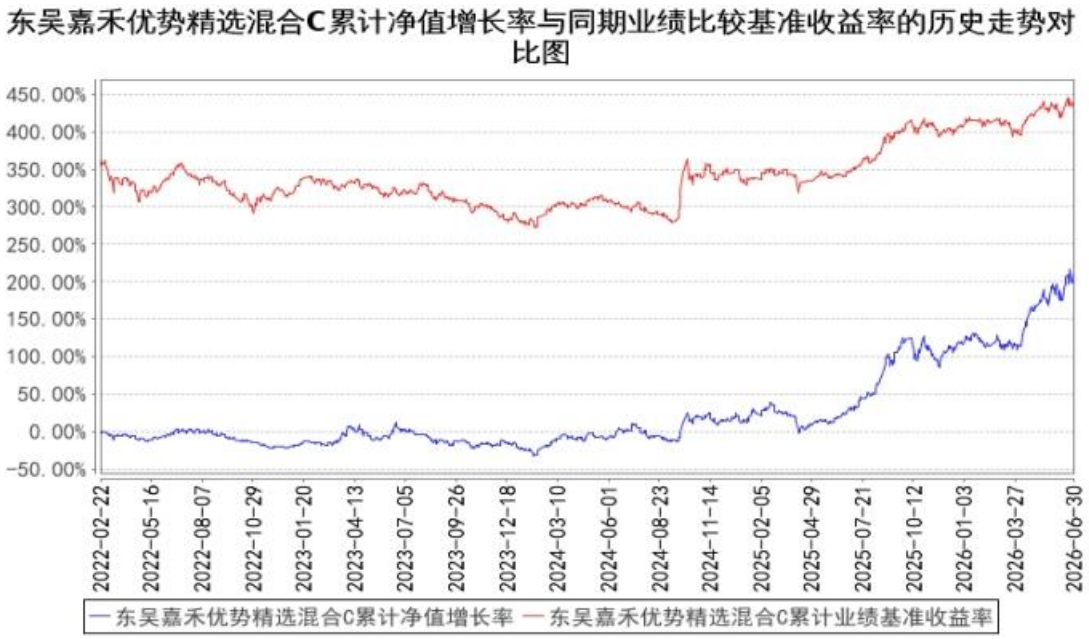
（二）东吴嘉禾优势精选基金累计净值增长率历史走势图

东吴嘉禾优势精选混合 A

（2005 年 2 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）

东吴嘉禾优势精选混合 C

（2022 年 2 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1、业绩比较基准=65%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中证全债指数。

2、本基金于 2022 年 2 月 22 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

3、本基金业绩比较基准收益率于 2021 年 4 季度起采用单日收益率加权方式进行计算。

十二、基金财产

（一）基金财产的构成：

1、银行存款及其应计利息；

2、清算备付金及其应计利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金；

4、应收证券交易清算款；

5、应收申购款；

6、股票投资及其估值调整；

7、债券投资及其估值调整和应计利息；

8、其它投资及其估值调整；

9、其它财产等。

（二）基金财产的帐户

基金开立专用银行存款账户和证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金代销机构、注册登记机构自有资产账户以及其他基金的资产账户相独立。基金专用账户须报中国证监会备案。

（三）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的固有财产，并由基金托管人保管，基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。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、基金托管人和基金代销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、扣押或其它权利。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》《运作办法》《基金合同》及其它有关规定承担基金财产本身债务之外，基金财产不得被强制执行。

十三、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

（二）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票，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,以最近交易日的市价(收盘价)估值；

在证券交易所市场流通的债券,按如下估值方式处理：

（1）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,按最近交易日的收盘价估值；

（2）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,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

送股、转增股、配股和增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值；该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值；

首次公开发行的股票,按成本估值；

在银行间同业市场交易的债券和未上市的债券一般按成本估值。如果估值不公允时由基金管理人与基金托管人协商确定公允价值。

3、配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,按估值日市价高于配股价的差额估值；收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

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

5、如有新增事项,按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布，并由基金管理人承担相应的责任。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产。

（四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后,将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人,基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（五）估值差错的确认与处理

各类基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后4位。当基金估值出现影响任一类基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；估值错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。相关当事人应将按照以下约定处理：

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、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其它当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其它差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其它当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更

正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其它规定，基金管理人和基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人和基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其它原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

（六）暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

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

（七）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第4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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其它不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（八）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十四、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）基金收益分配原则

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

（2）投资者可以选择现金分红方式或红利再投资分红方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；

（3）基金投资当期出现亏损,则不进行收益分配；

（4）基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

（5）基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行当期收益分配；

（6）在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至多分配八次,至少分配一次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配；

（7）全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%；

（8）法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在 2 日内公告，请投资者留意本基金指定的信息披露媒介。

（五）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式的免收再投资的费用；

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

（六）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

十五、基金费用与税收

（一）基金运作相关费用

1、管理费；

基金管理费以基金资产净值的 1.2％年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2％年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、托管费；

基金托管费按基金资产净值的 0.20%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计算，每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人

发送 C 类基金份额的销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中划出，由登记机构代收后一次性支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

4、投资交易费用；

5、银行汇划费用；

6、基金信息披露费用；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

9、按照国家有关规定的其他费用。

上述第 4 项至第 9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后，基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售相关费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的“（六）申购与赎回的数额与价格”的相关规定。

本基金转换费率由基金管理人届时另行规定。

（三）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或届时发布的相关公告。

（四）基金税收

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。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；本基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、本基金托管人与本基金管理人就本基金的基金资产净值、基金份额净值、报表等进行核对并确认。

（二）基金审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。

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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，基金管理人（或基金托管人）应当在两日内编制更换会计师事务所报告书,予以公告。

十七、基金的信息披露

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

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

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

本基金信息披露义务人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本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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

一、公开披露的基金信息

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持

有人服务等内容；

本基金合同生效后，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；

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

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

2、基金份额发售公告

基金管理人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。

3、基金募集情况

4、基金合同生效公告

基金管理人在本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。

5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金净值信息

本基金合同生效后，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各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，

通过其指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；

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

7、基金份额申购、赎回价格

基金管理人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，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

8、基金定期报告

包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

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

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

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

基金合同生效不足两个月的，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；

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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

9、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两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上；

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影

响的下列事件：

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）基金合同终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

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

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金募集期延长或提前结束募集；

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

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

（11）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

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

（14）基金收益分配事项；

（15）管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（16）任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、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、基金上市交易的证券交易所。

11、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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告；

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项；

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

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、实施侧袋机制期间的信息披露

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

14、中国证监会规定的其他信息

二、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的规定；

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和本基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认；

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时；

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致；

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

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

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。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制；

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。

十八、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

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

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

4、申购赎回的具体事项安排详见基金管理人届时的相关公告。

（三）实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露

主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

（五）实施侧袋账户期间的基金费用

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

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

（六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

（七）侧袋机制的信息披露

1、临时公告

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

2、基金净值信息

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

3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户及特定资产的相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

（1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；

（2）侧袋账户的初始资产、初始负债；

（3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；

（4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；

（5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；

（6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

（八）本部分关于侧袋机制的相关规定，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，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。

十九、基金的风险揭示

（一）市场风险

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

1、政策风险

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

2、利率风险

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

3、信用风险

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

4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

5、再投资风险

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

6、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

（二）管理风险

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

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基

金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

1、基金申购、赎回安排

本基金管理人加强申赎环节的管理，合理控制持有人集中度，审慎确认大额申购，避免出现单一持有人申购后份额超过 50%以上的情形，在单一份额持有人持有份额超过 50%时，拒绝其后续申购。当出现法律法规、基金合同约定的情形或接受申赎可能会对基金流动性产生影响时，基金管理人可以暂停本基金申购、延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请，详情请见本招募书第八章，基金份额的申购与赎回。

2、本基金拟投资市场行业及资产的流动性风险评估

本基金拟投资于沪深交易所股票、银行间和交易所债券、货币市场工具等投资品种。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，确保基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险。

3、巨额赎回情况下的流动性等风险管理措施

若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延缓支付赎回款项的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。本基金对持续持有期少于 7 日的投资人，收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资者赎回基金份额时收取。

当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值。投资者可能面临所查询到的净值不能及时、准确地反映基金投资的市场价值的风险。

5、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

具体措施详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。

6、基金报告及临时报告

在本基金持续运作过程中，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中披露该投资者的信息及风险。本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资

产情况及其流动性风险分析等。在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回的重大事项时，及时发布公告。

（四）策略风险

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

（五）投资科创板股票的风险

本基金可投资于科创板股票，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，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。投资科创板股票存在的风险包括：

1、市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌停限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

2、流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

3、信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

4、集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

6、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（六）其它风险

1、技术风险

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

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

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

二十、基金的终止与清算

（一）基金的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人将宣布《基金合同》终止；

2、《基金合同》经持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；

5、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；

6、中国证监会规定的其它情况。

（二）基金清算

1、基金清算小组成立：自基金终止之日起30个工作日内成立清算小组,基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

3、基金清算小组职责：基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（三）基金清算程序

1、基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

2、基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；

3、对基金财产进行评估；

4、对基金财产进行变现；

5、将基金清算结果报告中国证监会；

6、公布基金清算公告；

7、进行基金剩余资产的分配。

（四）清算费用

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

（五）基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 2 个工作日内由基金清算小组公告，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；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

（七）清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金资产；

（2）依照《基金合同》获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费以及基金管理费等其他法律法规规定的费用；

（3）销售基金份额；

（4）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

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

（6）提议召开基金份额持有人大会；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（9）依据本《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（10）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（11）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除托管费率和调高管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（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，为基金的利益行使基金所投资的证券项下的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）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；

（15）法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

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

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）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资产；

（3）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资产；

（4）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托符合条件的其

它机构代理该项业务；

（5）配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托符合条件的其它机构代理该项业务；

（6）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，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立,保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（7）除依据法律法规和《基金合同》及其它有关规定外,不得以基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

（8）依法接受基金托管人的监督；

（9）采取适当合理的措施使基金份额认购、申购、赎回的计算方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（10）严格按照《基金法》等法律法规和《基金合同》的关规定，履行信息披露及报告义务；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告，编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（13）按《基金合同》规定向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按照法律法规和本《基金合同》的规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（16）依据《基金法》等法律法规和《基金合同》的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；

（17）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；

（18）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本《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（19）参加基金资产清算组,参与基金资产的保管、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并通知基金托管人；

（21）因违反合同导致基金资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；

（22）基金托管人因违反合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托

管人追偿；

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）法律、法规和《基金合同》规定的其它义务。

（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：

(1)自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定安全保管基金资产；

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反本基金合同及国家法律法规行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户负责基金的债券及资金的清算；

(7)提议召开基金份额持有人大会；

(8)在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2．根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；

(2)设立专门的资产托管部，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，负责基金资产托管事宜；

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4)除依据法律法规和《基金合同》的规定外，不得利用基金资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资产；

(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，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，除法律法规和《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11)按有关规定，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)建立并保存基金份额持有人名册；

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14)依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金赎回和分红款项划往指定账户；

(15)按照规定召集基金份额持有人大会；

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17)参加基金资产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(19)因违反合同导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20)基金管理人因违反合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人的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定；

(22)法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，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本《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章为必要条件。

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)按本《基金合同》的规定取得基金收益；

(2)参与分配清算后的剩余基金财产；

(3)按《基金合同》的规定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)按本《基金合同》的规定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)因基金管理人、基金托管人、销售机构的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2．除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

3．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)遵守《基金合同》；

(2)缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》规定的费用；

(3)承担基金亏损或者合同终止的有限责任；

(4)不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；

(5)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(6)法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）因无法满足《基金合同》规定的条件而终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

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

（9）变更《基金合同》（《基金合同》中规定可由基金管理人和基金托管人协商后变更而无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；

（10）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更《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；

（2）在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行变更；

（4）对《基金合同》的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响或变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其它情形。

（二）会议召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集；

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10％（含 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；

5、如在上述第 4 条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案；

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

（三）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的至少一种全国性信息披露报刊上公告通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1)会议召开的时间、地点、方式；

(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4)代理投票授权委托书送达时间和地点；

(5)会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

（四）会议的召开方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，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。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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(2)经核对，汇总到会者出示的在权利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 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1)召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2)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；

(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 50%（含 50%）；

(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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的

规定；

(5)会议通知公布前报中国证监会备案。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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；也可以在现场会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 20 天提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 15 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 15 天的间隔期。基金份额持有人大会的召集人发出以通讯方式开会的通知后，该次基金份额持有人大会不得增加、减少或修改需由该次基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 15 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1)关联性。大会召集人对于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行解释和说明。

(2)程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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，或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，其时间间隔不少于六个月。

2、议事程序

(1)现场开会

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

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后两个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2.特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、决定终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，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，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1.现场开会

(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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。

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

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

(4)计票过程应由公证机关予以公证。

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。

3.公证机关对计票过程全程予以公证，并在公告基金份额持有人大会决议时公告公证书全文、公证机关及公证员姓名。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由会议召集人自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3.通讯开会的直接出具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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

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

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

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

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

三、基金合同的变更和终止

（一）《基金合同》的变更

1、《基金合同》变更下列内容，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，应当召开基金份额持有人大会：

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）转换基金运作方式；

（4）变更基金类别；

（5）变更基金投资目标、范围或策略；

（6）变更基金份额持有人大会程序；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（8）法律法规、中国证监会规定的其它事项。

2、除非法律法规和《基金合同》另有规定，对《基金合同》的变更应当召开基金份额持有人大会的，《基金合同》变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或备案。

3、依现行有效的有关法律法规，对《基金合同》的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

4、除依本《基金合同》和/或依现行有效的有关法律法规，对《基金合同》的变更须基

金份额持有人大会决议通过和/或须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对《基金合同》进行变更后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人将宣布《基金合同》终止；

2、《基金合同》经持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；

5、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；

6、中国证监会规定的其它情况。

四、争议的解决

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；也可按工本费购买《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。

二十二、基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

（一）基金管理人

基金管理人名称：东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

法定代表人：李素明

注册资本：人民币 10000 万元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

经营期限：永久存续

（二）基金托管人

名称：中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 （100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：国有独资企业

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；证券投资基金托管；社保基金托管；企业年金托管；委托资产托管；信托资产托管；基本养老保险个人账户基金托管；农村社会保障基金托管；投资连接保险产品的托管；收支账户的托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管。

二、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据《基金法》《基金合同》、本协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人

报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》《基金合同》、本协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过错致使投资者遭受的损失。

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

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

2、根据《基金法》《基金合同》、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》《基金合同》、本协议或有关基金法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

三、基金财产的保管

（一）基金资产保管的原则

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。

基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于基金申（认）购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

（二）募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“东吴基金管理有限公司基金认购专户”。基金设立募集期满，由基金管理人在十日内聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具基金资产接收报告。

（三）投资者申购资金和赎回资金的划付

基金申购、赎回的款项采用单笔净额交收的结算方式，净额在 T+3 日上午 11：00 前交收。

基金托管人应及时查收申购资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，由基金管理人负责处理相关事宜。

因投资者赎回而应划付的款项，基金托管人应根据基金管理人的指令进行划付。

（四）基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理

人不得假借本基金的名义开立任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》《现金管理条例》《中国人民银行利率管理的有关规定》《关于大额现金支付管理的通知》《支付结算办法》以及中国人民银行的其他规定。

（五）基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

（六）债券托管乙类账户的开设和管理

1、基金合同生效后，基金管理人负责向中国证监会和中国人民银行申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

（七）基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

（八）与基金资产有关的重大合同的保管

与基金有关的重大合同的签署，除本协议另有规定外，由基金管理人代表基金签署。签署时应保证基金一方持有两份以上正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。

四、基金资产净值的计算和复核

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

基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册由基金过户与注册登记人负责制定。基金过户与注册登记人对基金份额持有人名册负保管义务。

六、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

七、托管协议的修改与终止

1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；

（3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；

（4）发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

二十三、对基金份额持有人的服务

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

（一）持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

（二）持有人交易记录查询及定期对帐单服务

1、本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

2、定期对账单服务

基金管理人设立客户服务部门。对账单服务分为电子对账单服务和纸质对账单服务。每月度、季度、年度结束后 10 个工作日内，客户服务部门将通过邮件向所有选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单，记录该持有人最近一月度，或一季度或一年度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后 30 个工作日内，客户服务部门将向本年度有交易的或持有份额的，且选择纸质对账单服务的基金份额持有人寄送该持有人最近一年度纸质对账单。基金份额持有人也可通过基金公司网站下载电子对账单或拨打基金公司客服热线索取电子或纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

（三）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额，且不收取任何申购费用。若基金份额持有人不选择此项服务，本基金将按照默认的现金分红方式对红利予以发放。

（四）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体方法另行公告。

（五）客户服务中心（Call Center）

客服中心自动语音系统提供 7×24 小时基金交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

客服中心人工坐席在每个工作日提供不少于 8 小时的坐席服务，投资者可以通过拨打热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、资料修改、疑难解答、客户投诉/意见/建议处理、信函补寄、基金信息的定制等专项服务。

客户服务电话：4008210588

（六）网络服务

公司网站可为客户提供下列服务：信息定制、在线账户查询、信息下载、专家在线咨询、举办网上活动等。

公司网站：www.scfund.com.cn

二十四、其他应披露事项

（1）2025 年 08 月 29 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告》；

（2）2025 年 08 月 29 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2025 年中期报告》；

（3）2025 年 09 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告》；

（4）2025 年 09 月 12 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要》；

（5）2025 年 09 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加世纪证券有限责任公司申购补差费率优惠的公告》；

（6）2025 年 09 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证达通基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（7）2025 年 10 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告》；

（8）2025 年 10 月 28 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》；

（9）2025 年 10 月 29 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增方正证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告》；

（10）2025 年 11 月 25 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台的公告》；

（11）2025 年 11 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告》；

（12）2025 年 12 月 10 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发证券股份

有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告》；

（13）2025 年 12 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台的提示性公告》；

（14）2026 年 01 月 08 日在上海证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金暂停非个人投资者大额申购（含定期定额投资）、大额转换转入业务的公告》；

（15）2026 年 01 月 09 日在上海证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金分红公告》；

（16）2026 年 01 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳腾元基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（17）2026 年 01 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（18）2026 年 01 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告》；

（19）2026 年 01 月 22 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》；

（20）2026 年 02 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司高级管理人员变更公告》；

（21）2026 年 02 月 25 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加华泰证券股份有限公司申购补差费率优惠的公告》；

（22）2026 年 03 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（23）2026 年 03 月 31 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》；

（24）2026 年 03 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公

告》；

（25）2026 年 03 月 31 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2025 年年度报告》；

（26）2026 年 04 月 17 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告》；

（27）2026 年 04 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告》；

（28）2026 年 04 月 22 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》；

（29）2026 年 04 月 30 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《2025 年度东吴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露》；

（30）2026 年 05 月 07 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方证券股份有限公司定期定额投资业务的公告》；

（31）2026 年 05 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告》；

（32）2026 年 06 月 01 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》；

（33）2026 年 06 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于终止深圳市金海九州基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告》；

（34）2026 年 06 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告》；

（35）2026 年 06 月 25 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务的公告》；

（36）2026 年 07 月 03 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告》；

（37）2026 年 07 月 21 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、

中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2026 年 2 季度报告提示性公告》；

（38）2026 年 07 月 21 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2026 年第 2 季度报告》；

（39）2026 年 07 月 21 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市排排网基金销售有限责任公司为代销机构、开通定期定额投资及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（40）2026 年 07 月 29 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告》；

（41）2026 年 08 月 06 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券股份有限公司为销售机构、开通定期定额投资及转换业务的公告》。

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅；按支付工本费后，可在合理时间内取得本基金招募说明书复制件或复印件,但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

（一）中国证监会批准“东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金”募集的文件

（二）《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金合同》

（三）法律意见书

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（五）基金托管人业务资格批件和营业执照

（六）《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金托管协议》

（七）中国证监会要求的其他文件

东吴基金管理有限公司

二零二六年九月