

香港說明文件－2016年1月

上投摩根新興動力 混合型證券投資基金

內地與香港互認基金系列



基金管理人：

香港主銷售商：

上投摩根
基金管理

摩根
資產管理

上投摩根新興動力混合型證券投資基金
(「本基金」)

第四次增編

本第四次增編乃日期為2016年1月的本基金之香港說明文件(經不時修訂)(「香港說明文件」)及日期為2019年8月的本基金之產品資料概要(「產品資料概要」)之組成部分，並應與其一併閱讀。

上投摩根基金管理有限公司(「基金管理人」)願就本次增編所載資料之準確性承擔全部責任，並於作出所有合理查詢後，確認盡其所知及所信，概無其遺漏可導致任何陳述為誤導之其他事實。

本文使用的詞彙與香港說明文件及產品資料概要所賦予者具有相同含義(除非另有所指)。

由2020年1月1日起，香港說明文件將作出以下之修訂：

(i) 刪除香港說明文件第19頁「報告」一節下第一段的段落全文，並以下文代：

「載有財務報表的經審核年報、未經審核半年度報告及季度報告，將根據招募說明書「十五、基金的信息披露」一節提供予每名基金單位持有人。年報將於每年度結束之日起三個月內提供。本基金的半年度報告將於每年上半年結束之日起兩個月內提供。本基金的季度報告將於每個季度結束之日起計15個工作日內提供。」

(ii) 刪除香港說明文件第19頁「供投資者查閱的文件」一節下的第(iv)項的段落全文，並以下文代：

「向中國證監會註冊的本基金招募說明書及基金產品資料概要(如本基金招募說明書「十五、基金的信息披露」一節中所規定的)、本基金香港說明文件及產品資料概要(經不時修訂)；」

(iii) 刪除香港說明文件第20頁「供投資者查閱的文件」一節下最後一段的段落全文，並以下文代：

「就(iv)項而言，本基金的招募說明書及基金產品資料概要(如本基金招募說明書「十五、基金的信息披露」一節中所規定的)至少每年更新一次；而香港說明文件及產品資料概要將在必要時更新以反映有關更改。」

上投摩根基金管理有限公司

2019年12月

上投摩根新興動力混合型證券投資基金 (「本基金」)

第三次增編

本第三次增編乃日期為2016年1月的本基金之香港說明文件(經不時修訂)(「香港說明文件」)及日期為2019年8月的本基金之產品資料概要(「產品資料概要」)之組成部分，並應與其一一併閱讀。

上投摩根基金管理有限公司(「基金管理人」)願就本次增編所載資料之準確性承擔全部責任，並於作出所有合理查詢後，確認盡其所知及所信，概無其遺漏可導致任何陳述為誤導之其他事實。

本文使用的詞彙與香港說明文件及產品資料概要所賦予者具有相同含義(除非另有所指)。

香港說明文件應作出以下之修訂：

加強披露風險因素

- (i) 刪除香港說明文件第9頁「風險因素」一節下「**5. 中國內地股票風險**」的「高估值風險」段落全文，並以下文代：

「高估值風險：於中國內地證券交易所上市的股票，尤其是中國創業板、中小板及科創板股票可能有較高市盈率的風險。高估值未必得以持續及股票價格可能大幅下跌。」

- (ii) 刪除香港說明文件第9-10頁「風險因素」一節下「**6. 中小企業板(中小板)及／或創業板市場的相關風險**」分節全文，並以下文代：

「**6. 中小企業板(中小板)、創業板市場及／或科創板的相關風險**

- 股價及流動性風險波動較高：在中小板、創業板市場和／或科創板上市的公司通常經營規模較小而具有新興性質。尤其是在科創板上市的上市公司，相比在其他板上市，由於受到更廣泛的價格波動限制及投資者的進入門檻較高，其流動性可能有限。因此，相比在主板上市的公司，於中小板、創業板市場及科創板上市的公司面對較高的股價和流動性風險波動，以及較高的風險和換手率。
- 過度估值風險：在中小板、創業板市場和／或科創板上市的股票可能被高估，這種極高的估值可能無法持續。股價可能更容易由於較少的流通股而受到操縱。

- 法規的差異：相比主板和中小板，有關創業板市場及科創板上市公司的盈利能力及股本方面的規則與條例並不嚴格。
- 退市風險：在中小板、創業板市場和／或科創板上市的公司可能更常見和更快退市。尤其是科創板，相比其他上市板會有更嚴格的退市標準。如果本基金所投資的公司退市，可能對本基金產生不利影響。
- 集中風險：科創板是新成立的上市板，在初始階段可能擁有有限數量的上市公司。投資於科創板可能會集中在少數股票上，使基金帶來更高的集中風險。
- 在中小板、創業板市場和／或科創板的投資可能會導致對本基金及其投資者重大的損失。」

上投摩根基金管理有限公司

2019年8月

上投摩根新興動力混合型證券投資基金
(「本基金」)

第二次增編

本第二次增編乃日期為 2016 年 1 月的本基金之香港說明文件（經不時修訂）（「香港說明文件」）及日期為 2016 年 1 月的本基金之產品資料概要（「產品資料概要」）之組成部分，並應與其一併閱讀。

上投摩根基金管理有限公司（「基金管理人」）願就本次增編所載資料之準確性承擔全部責任，並於作出所有合理查詢後，確認盡其所知及所信，概無其遺漏可導致任何陳述為誤導之其他事實。

本文使用的詞彙與香港說明文件及產品資料概要所賦予者具有相同含義（除非另有所指）。

香港說明文件及產品資料概要應作出以下之修訂：

1. 修改供投資者查閱的文件語言

由即日起，刪除香港說明文件第 20 頁「**供投資者查閱的文件**」一節下第三及第四段全文，並以下文代：

「上文(i)、(ii)、(iii)、(v)、(vi)及(ix)項將僅備有簡體中文版本。(iv)及(viii)項將僅備有英文及繁體中文版本。(vii)項將僅備有英文版本。

投資者可向香港代表提交書面要求索取有關(ii)及(v)項英文或繁體中文版本的特定資料。香港代表將在切實可行下盡快回應有關要求。」

2. 修改中小板用語

由即日起，在香港說明文件內使用之「中 / 小型企業」及「**中小企**」用語將以「中小企業板」及「**中小板**」取代。

3. 更新風險因素披露

由即日起，刪除香港說明文件第 9-10 頁「**風險因素**」一節下「**6. 中國創業板市場及中小企風險**」分節全文，並以下文代：

「6. 中小企業板（中小板）及／或創業板市場的相關風險

- 股價波動較高：在中小板和／或創業板市場上市的公司通常經營規模較小而具有新興性質。因此，相比在主板上市的公司，他們面對較高的股價和流動性波動，以及較高的風險和換手率。
- 過度估值風險：在中小板和／或創業板上市的股票可能被高估，這種極高的估

值可能無法持續。股價可能更容易由於較少的流通股而受到操縱。

- 法規的差異：相比主板和中小板，有關創業板市場上市公司的盈利能力及股本方面的規則與條例並不嚴格。
- 退市風險：在中小板和／或創業板市場上市的公司可能更常見和更快退市。如果本基金所投資的公司退市，可能對本基金產生不利影響。
- 在中小板和／或創業板市場的投資可能會導致對本基金及其投資者重大的損失。」

上投摩根基金管理有限公司

2016年7月

上投摩根新興動力混合型證券投資基金
(「本基金」)

第一次增編

本第一次增編乃日期為 2016 年 1 月的本基金之香港說明文件（經不時修訂）（「香港說明文件」）及日期為 2016 年 1 月的本基金之產品資料概要（「產品資料概要」）之組成部分，並應與其一併閱讀。

上投摩根基金管理有限公司（「基金管理人」）願就本次增編所載資料之準確性承擔全部責任，並於作出所有合理查詢後，確認盡其所知及所信，概無其遺漏可導致任何陳述為誤導之其他事實。

本文使用的詞彙與香港說明文件及產品資料概要所賦予者具有相同含義（除非另有所指）。

香港說明文件及產品資料概要應作出以下之修訂：

1. 交易程序的強化披露

由即日起，於香港說明文件第 11 頁「香港的交易及結算程序」一節的最後一段後，以及產品資料概要第 5 頁「其他資料」一節的第二小點之後，插入以下的強化披露陳述：

「由於市場事件的原因，交易及截止時間安排也可能有所變化。投資者應向香港代表或其認可分銷商查詢相關交易和截止時間的安排。」

上投摩根基金管理有限公司

2016 年 1 月

上投摩根新興動力混合型證券投資基金

一項根據基金管理人與基金託管人簽訂由 2011 年 7 月 13 日起生效（及經不時修訂）
的基金合同成立，
並受《中華人民共和國證券投資基金法》監管的基金

香港說明文件

本文件（下文稱「香港說明文件」）為上投摩根新興動力混合型證券投資基金（「本基金」）的招募說明書（經不時修訂）（「招募說明書」）及本基金的產品資料概要的補充文件及構成其一部分，並應一併閱讀。除非本香港說明文件另有規定，否則招募說明書中所界定詞彙的涵義應與本香港說明文件所載者相同。

2016年1月

投資者須知

閣下如對招募說明書、本香港說明文件或產品資料概要的內容有任何疑問，應諮詢閣下的銀行經理、法律顧問、會計師或其他獨立財務顧問。

本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司就招募說明書、本香港說明文件及本基金的產品資料概要所載資料的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，據其所知及所信，並無遺漏致使此等文件中任何陳述有誤導成份的任何其他事實。然而，派發招募說明書、本香港說明文件或本基金的產品資料概要或提呈發售或發行單位，在任何情況下，均不構成有關招募說明書、本香港說明文件或本基金的產品資料概要所載資料於刊發日期後任何時間仍屬正確的陳述。此等文件可不時予以更新。

本基金為根據基金管理人與基金託管人簽訂由2011年7月13日起生效（及經不時修訂）的基金合同成立的開放式契約型投資基金。本基金已在中國證券監督管理委員會（「**中國證監會**」）註冊登記，並須持續接受中國證監會監管。

本基金已根據香港《證券及期貨條例》（「**證券及期貨條例**」）第104條在香港獲證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）認可及可供在香港向公眾銷售。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業利弊或其表現作出保證。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或任何類別投資者。

本香港說明文件及本基金的產品資料概要只編備以供在香港派發。此等文件載有本基金獲認可在香港分銷的額外詳情，並必須連同本基金的最新可得招募說明書一併閱讀。

單位只可按照招募說明書、本香港說明文件及產品資料概要（須連同最近期的年報及（如在其後刊發）最近期的半年度和季度報告方為有效）所載資料發售。

尤其是：

美國

本基金並未根據美國（「**美國**」）《證券法》（經修訂）（「**該法令**」）或在美國任何司法管轄區所制定法律的任何類似或相近條文註冊。單位不可提呈或出售予任何美國人士，惟獲基金管理人按其絕對酌情權給予豁免則除外。就此而言，美國人士的定義為按照該法令、《關於遵守商品期貨交易委員會若干掉期規定的解釋性指引和政策聲明》（Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations of the Commodities Futures Trading Commission）（經修訂）或美國《國內稅收法》（「**國稅法**」）於下文所列或在美國聯邦所得稅法下所界定者（如下文第1至4段內所述）或由若干美國人擁有的非美國實體（如下文第5段所述）：

1. 就美國聯邦所得稅而言，指屬於美國公民或居於美國之外國人的個別人士。一般來說，就此而言，「**居於美國之外國人**」的定義包括以下任何個別人士：(i)持有美國移民局發出的外國人登記卡（「**綠卡**」）或(ii)通過「實質居留」測試。要通過「**實質居留**」測試，一般

就任何曆年而言：(i)個別人士須於該年度內在美國居留最少31日及(ii)該名人士於該年度內在美國居留的日數，加前一年內在美國居留的日數的三分之一，再加前兩年內在美國居留的日數的六分之一後三者的總和，須相等於或多於183日；

2. 企業、如企業般應課稅的實體，或在美國或美國的任何州或政治分區（包括哥倫比亞特區）設立或組成或根據當地法例設立或組成的合夥企業（根據財政部規例不被視為美國人士合夥企業則除外）；
3. 不論收入來源但收入須繳納美國聯邦所得稅的遺產；
4. 美國境內法院能對其行政行使主要監管及一名或以上美國人士有權控制其絕大部分決定的信託，或於1996年8月20日已經存在而於1996年8月19日被視為國內信託的若干選定信託；或
5. 擁有一名或多名本身為美國人士（如上文第1段所述）的「**控制權人士**」的外國被動非金融實體（「**被動NFFE**」）（定義見美國及任何其他司法管轄區之間可能訂立與《海外賬戶稅收合規法案》（如國稅法第1471至1474條所載）（「**FATCA**」）有關的任何跨政府協議（「**跨政府協議**」））。被動NFFE一般並非為「公開買賣公司」亦非「主動NFFE」（定義見適用的跨政府協議）的非美國及非金融機構實體。

中港基金互認（「**基金互認**」）

於2015年5月22日，證監會與中國證監會簽署《關於內地與香港基金互認安排的監管合作備忘錄》（「**備忘錄**」）。備忘錄提供中國證監會與證監會之間對開發售基金互認的框架，使此等認可基金可於兩地市場向公眾發售。

在基金互認的框架下，受中國證監會監管並向中國內地（即中華人民共和國，就本香港說明文件而言，不包括香港、澳門及台灣）公眾發售的證券投資基金，可獲證監會認可並可向香港公眾發售，惟須受證監會施加的任何額外規定所規限。

本基金在中國證監會註冊登記及受其監管，並且已根據證券及期貨條例獲證監會按照基金互認的條款認可。根據基金互認的條款，本基金按以下原則運作：

- a) 本基金符合證監會發佈的現行合資格規定；
- b) 本基金維持在中國證監會註冊登記，並獲准在中國內地境內向公眾推銷；
- c) 本基金一般根據中國內地的相關法律法規及其組成文件（即基金合同）運作及接受管理；
- d) 本基金在香港銷售及分銷須遵從香港的適用法律法規；
- e) 本基金將遵從證監會頒佈有關認可、獲認可後及持續遵守，以及本基金在香港銷售及分銷的額外規則；及

- f) 在本基金維持獲證監會認可期間，基金管理人須確保中國內地及香港的基金單位持有人均獲得公平和相同的待遇，包括有關投資者保障、權利的行使、賠償及資料披露等方面。

基金管理人確認，中國內地及香港的基金單位持有人均會根據上文(f)獲得公平和相同的待遇。

本基金為基金互認的基金，並須符合以下合資格規定：

- a) 本基金為基金互認的合資格基金類型；
- b) 本基金根據中國內地的法律法規及其組成文件設立及管理 and 運作；
- c) 本基金是根據《中華人民共和國證券投資基金法》在中國證監會註冊登記的公開發售證券投資基金；
- d) 本基金已設立超過1年；
- e) 本基金的最低資金規模不少於人民幣2億元或不同貨幣的等值；
- f) 本基金並非主要投資於香港市場；及
- g) 本基金向香港投資者銷售本基金的單位價值不得超過本基金的總資產價值的50%。

基金管理人根據中國內地的法律法規在中國內地註冊登記及運作，並獲中國證監會發牌管理公開發售的證券投資基金。

基金託管人根據中國內地的法律法規符合資格擔任公開發售證券投資基金的託管人。

獲證監會認可後，如本基金不再符合證監會不時訂明的規定，基金管理人應立即通知證監會，故此，本基金不可再於香港向公眾推銷，且不可接受新的申購。

投資者應注意，當出售予香港投資者的本基金單位的價值即將達到上述分段(g)所述的50%限額時，本基金應立即以書面通知證監會，以及暫停申購或應用一個公平方式分攤處理申購指示直至到達50%限額為止。此外，所有基金互認的基金（包括本基金）須受一個整體額度限制。額度一經用盡，本基金或須暫停接受申購。在此等情況下，存在著香港投資者未必能夠申購其有意申購的單位數目（或根本無法申購任何單位）的風險。為免生疑問，即使到達50%限額或額度已用盡，香港投資者可繼續持有其於本基金的現有單位，而該等單位將不會被強制贖回。

香港代表

香港代表是摩根基金（亞洲）有限公司。香港代表已根據《單位信託及互惠基金守則》獲上投資摩根基金管理有限公司委任。香港代表的費用（如有）由基金管理人承擔。

香港代表的聯絡資料：

地址：香港中環干諾道中8號遮打大廈21樓

電話：(852) 2978 7788

向基金單位持有人提供的服務

在不損害中國內地及香港投資者平等待遇的原則下，在招募說明書中提及的若干服務可能無法向香港投資者提供（如有關不會向香港投資者提供的A類基金單位的資料、招募說明書「**五、相關服務機構**」一節「**（一）基金銷售機構**」分節、「**二十、對基金單位持有人的服務**」所列的服務）。香港投資者應向當地認可分銷商了解進一步詳情。不同的認可分銷商可能就投資本基金提供不同類型服務。請向相關認可分銷商了解詳情。

查詢及投訴

投資者如對本基金有任何查詢或投訴，可聯絡或致電香港代表（香港代表的地址及電話載於「**香港代表**」一節）。

就一般查詢或投訴而言，香港代表將於收到有關查詢或投訴後五個香港交易日內，以書面回覆有關投資者。查詢及投訴將按個別情況處理。

進一步資料

投資者可瀏覽香港代表的網站 www.jpmorganam.com.hk 以取得本基金的進一步資料，包括銷售文件、財務報告、通知、最近的基金單位淨值及分派的組成成分。此網站並未經證監會審閱。

未經證監會認可的計劃

就香港發售文件（包括在中國證監會登記的招募說明書、香港說明文件及產品資料概要）所載的基金，只有以下基金獲證監會認可，可根據《證券及期貨條例》第104條在香港向公眾發售。

(a) 上投摩根新興動力混合型證券投資基金

警告： 謹請注意，香港發售文件（包括在中國證監會登記的招募說明書、香港說明文件及產品資料概要）所述的其他基金，未必獲證監會認可在香港向公眾銷售。除非《證券及期貨條例》第103條下的豁免適用，否則向香港公眾發售任何未獲證監會認可的基金即屬違法行為。中介人應注意此限制。

可供香港投資者申購的股份類別

只有H類基金單位可供香港投資者申購。香港投資者應留意本香港說明文件中所披露有關該H類基金單位的詳情及具體特點。如與招募說明書所載有關H類基金單位的任何資料有歧義，概以本香港說明文件披露者為準。

H類基金單位以人民幣（「人民幣」）計價。H類基金單位的初始價值將定為A類基金單位於H類基金單位首次申購日期的資產淨值。

H類基金單位的基金單位淨值是於收市後將H類基金單位的資產淨值，除以於有關香港交易日的H類基金單位總數計算。

H類基金單位將根據下文「**香港的交易及結算程序**」所載的程序買賣。

更改及通知

本基金的更改將根據適用中國內地法律法規及本基金組成文件的條款作出。該等更改須經中國證監會批准或已遵從中國內地的適用程序方可生效，其後的更改須提交予證監會存檔。有關本基金於基金互認安排下的資格之更改（如本基金的投資目標、策略及主要營運商的更改）將一般須經證監會的事先批准。僅影響香港投資者的更改（如香港代表的更換）或須根據守則的適用規定獲證監會事先批准。根據適用監管規定基金單位持有人將獲通知有關更改。一般而言，有關影響香港投資者的更改的通知將以英文及繁體中文刊載於香港代表的網站 www.jpmorganam.com.hk。此網站並未經證監會審閱。

基金管理人將採取合理步驟及措施，以確保本基金的持續資料披露將同時提供給中國內地投資者及香港投資者，惟僅就並無於香港提供及與香港投資者無關的本基金股份類別而發給中國內地投資者的任何通知，或對香港投資者並無影響的發行相關事項的任何通知，則屬例外。

投資目標及策略

投資者謹請注意招募說明書「**八、基金的投資**」一節及產品資料概要所載有關本基金投資的投資目標、策略及其他詳情。

為清晰說明，儘管招募說明書有所披露，惟本基金將僅為對沖目的而運用金融衍生工具。如此意向日後有變，將會事先尋求監管批准及將給予投資者最少1個月的事先通知。

本基金僅會在內地市場進行投資。

本基金可將本基金的資產淨值最多**95%**投資於中國創業板及中 / 小型企業（「**中小企**」）股票。

本基金可將其資產淨值最多**40%**投資於債券，可包括資產支持證券及城投債。

本基金目前只投資於在作出投資時獲中國內地信貸評級機構給予**BBB-**或以上評級的債務證券。如有關債務證券的信貸評級被調低至低於**BBB-**級，基金管理人將在顧及投資者的利益下，尋求因應當時市況以逐步有秩序的方式出售所有該等被調低評級的債務證券。

本基金的總槓桿程度將不超過本基金資產淨值的**40%**，並僅會以回購交易的形式進行。

證券借貸及 / 或回購交易的其他披露

本基金現時無意訂立證券借貸。倘此政策有變，將會事先尋求監管批准及將給予單位持有人最少一個月的事先通知。在符合本基金投資目標和策略的最低投資規定及其他適用監管規定的情況下，本基金可將其資產淨值最多 40% 在交易所市場及銀行間市場訂立回購交易及反向回購交易。

(A) 交易所市場

就於中國內地的交易所市場進行的回購 / 反向回購交易而言，所有該等交易均於中國證券登記結算有限責任公司（「**中國結算**」）中央結算及交收，而中國結算實際上擔任該等交易的唯一對手方。

倘本基金訂立回購交易，本基金將收取現金（即借入現金）及提供將由中國結算託管的抵押品。

就反向回購交易而言，本基金將向中國結算支付現金（即借出現金），並須承受中國結算的對手方風險。以對手方借入現金提供的抵押品將交由中國結算託管並作受惠人。

證券交易所決定對對手方可用作為抵押品的債券類型。在一般情況下，抵押品可包括由中國內地的信貸評級機構評為 AA 或以上信貸評級的政府債券及 / 或公司債券。證券交易所亦為不同類型的債券訂下規定的扣減率。抵押品每日按市值計價，以確保抵押品的價值大於或相等於該等回購 / 反向回購交易的價值。倘抵押品的價值跌至低於抵押金額，參與相關交易的相關參與方須交付額外現金或抵押品，否則中國結算有權出售現有抵押證券，並收回違約參與方的任何未償還金額。本基金可在交易所市場訂立質押回購 / 反向回購交易或「**收買**」回購 / 反向回購交易。就質押回購 / 反向回購交易而言，抵押品的擁有權不會轉移至另一方，但抵押品反而會在中國結算的特定質押賬戶中託管，直至借出現金償還為止。就「**收買**」回購 / 反向回購交易而言，抵押品的擁有權將在起始時轉移至買方，並在借出現金償還後轉回至賣方。

(B) 銀行間市場

倘本基金於中國內地的銀行間市場進行回購 / 反向回購交易，基金管理人將按照對手方的業務性質、規模、聲譽、財務狀況及往績記錄等為該等交易挑選對手方。

於回購交易中，本基金將收取現金（即借入現金）及質押抵押品，抵押品將由銀行間市場清算所股份有限公司（「**上海清算所**」）或中央國債登記結算有限責任公司（「**中央結算公司**」）收取及託管。

就反向回購交易而言，本基金將支付現金（即借出現金），以及借入現金的對手方質押的抵押品將由上海清算所或中央結算公司代表本基金收取及託管。

倘本基金於銀行間市場訂立反向回購交易，本基金可接受的抵押品可包括現金，以及獲中國內地信貸評級機構給予 AA 或以上信貸評級的政府債券、地方政府債券、央行票據、商業銀行債券、非銀行金融機構債券、公司債券、商業票據及 / 或中期票據。本基金可接受的抵押品亦應遵從適用規則及規例。基金管理人將就抵押品採取審慎扣減政策，當中將考慮如債券信貸評級

及質素等因素。有別於在交易所市場進行的回購 / 反向回購交易，抵押品不會每日按市值計價。在正常情況下，基金管理人將旨在訂立該等相對短期的交易，以減輕所收取的抵押品的市場風險。本基金只在銀行間市場訂立已質押回購 / 反向回購交易（即抵押品的擁有權不會轉移至另一方，但抵押品反而會在相關證券結算公司託管，直至借出現金償還為止）。

就回購交易而言，本基金收到的現金款項可按基金管理人的酌情權，用作流動性管理及 / 或再投資。鑑於自反向回購交易收取的抵押品將由中國結算、上海清算所或中央結算公司託管，本基金不會將該等抵押品用作為其他回購交易的抵押物，或以獲取現金作為流動性管理及 / 或再投資。

任何所產生的新增收入於扣減各方（如託管銀行、國際結算組織或運作或管理該等交易的代理）收取的任何費用後，將計入本基金的賬戶。回購 / 反向回購交易可透過基金管理人、基金託管人或其關連人士進行，而在該情況下，每一方（視情況而定）將有權按商業原則保留一項費用，惟所有交易應以公平磋商及按最佳可得條款進行（即有關費用不得高於相同規模及性質的交易的現行市場費率），以及在本基金的年報中定期披露該等應付予相關關連人士的費用。

風險因素

投資者應參閱招募說明書中與投資於本基金相關的「十六、風險披露」一節及以下投資於本基金相關的風險的額外資料：

1. 投資風險

- 本基金是一項投資基金。概不保證本金可獲償還。本基金亦不保證於投資者持有本基金的單位期間會支付股息或分派。此外，概不保證本基金將能夠實現其投資目標，亦概不保證既定策略能夠順利執行。在極端情況下，投資者可能會失去全部原有投資金額。
- 基金管理人對經濟結構調整和產業升級的理解偏差或對上市公司的基本方面研究不夠深入，而可導致對行業和個別股票判斷不夠準確。

2. 與基金互認安排相關的風險

- **額度限制：**中港基金互認（基金互認）計劃受限於整體額度限制。如該額度已用盡，本基金單位的申購可隨時被暫停。
- **未能符合資格規定：**如本基金不再符合基金互認下的任何資格規定，其可能不得接受新的申購。在最壞的情況下，證監會甚至可因本基金違反資格規定而撤銷本基金在香港作公開發售的認可。概不保證本基金可持續符合該等規定。
- **中國內地稅務風險：**目前，根據基金互認制度，本基金及 / 或其投資者可享受若干稅務寬減及豁免。概不保證該等寬減及豁免或中國內地稅務法律及法規不會變更。現有寬減及豁免以及相關法律及法規的任何變更可能對本基金及 / 或其投資者造成不利影響，而彼等可能因此蒙受重大損失。
- **不同的市場慣例：**中國內地與香港的市場慣例可能有所不同。此外，本基金與其他在香港發售的公募基金的運作安排在若干方面可能有所不同。例如，本基金單位的申購或贖回只可於中國內地與香港市場同時開放的日子才獲處理，或本基金的截止時間或交易日安排可能與其他證監會認可基金不同。投資者應確保其了解此等分別及其影響。

3. 集中風險／中國內地市場風險

- 本基金主要投資於與中國內地市場有關的證券，並可能須承受額外的集中風險。投資於中國內地市場可能會帶來不同風險，包括政治、政策、稅務、經濟、外匯、法律、監管及流動性風險。

4. 人民幣貨幣及兌換風險

- 人民幣目前不可自由兌換，並受兌換控制及限制所限。
- 人民幣並非基礎貨幣的投資者須承受外匯風險，以及概不保證人民幣兌投資者的基礎貨幣（例如港元）的價值不會貶值。人民幣如有任何貶值，會對投資者在本基金的投資的價值構成不利影響。
- 基於適用於人民幣的兌換管制及限制，於贖回投資及／或支付股息時，投資者可能不會收到人民幣或該等付款可能受到延誤。
- 本基金及 H 類基金單位均以中國元（CNY）計值。就在申購 H 類基金單位之前需要兌換為人民幣的投資者而言，香港離岸人民幣市場的匯率（即 CNH 匯率）可能為 CNY 匯率（即中國內地在岸人民幣市場的匯率）的一個溢價或折讓。

5. 中國內地股票風險

- **市場風險**：本基金在股本證券的投資須承受一般市場風險，該等證券的價值可能基於各種因素（例如：投資氣氛、政治與經濟狀況的轉變及發行人的特定因素）而波動不定。
- **波動性風險**：中國內地股票市場的高市場波動性及潛在結算困難，亦可能導致在該等市場買賣的證券價格大幅波動，因而可能對本基金的價值造成不利影響。
- **政策風險**：中國內地證券交易所通常有權暫停或限制任何在有關交易所買賣的證券的買賣。政府或監管機構亦可實施可能影響金融市場的政策。所有此等情況均可能對本基金造成負面影響。
- **小型／中型公司相關的風險**：與較大型的公司相比，一般而言，小型／中型公司股票流動性可能較低，而其價格在不利經濟發展情況下亦更為波動不定。
- **高估值風險**：於中國內地證券交易所上市的股票，尤其是中國創業板及中小企股票可能有較高市盈率的風險。高估值未必能持續及股票價格可能大幅下跌。
- **流動性風險**：與其他已發展市場相比，中國內地證券市場的流動性可能較低。中國內地股票須承受政府干預的風險，例如暫停買賣及交易波幅限額。倘本基金未能於其認為理想時間出售其於中國內地股票的投資，可能會蒙受重大損失。

6. 中國創業板市場及中小企風險

- 在中國創業板市場上市的公司（例如：創新企業）及中小企通常尚在發展初段，營運規模較小及營運歷史較短，業務模式尚未成熟及風險管理能力較弱，以及其業務的不確定因素通常較高及其業績表現較為波動。因此，其穩定性及抵禦市場風險的能力可能較低。故此，與在主板上市的公司相比，該等公司須承受較大的市場波動及風險，以及較高的周轉率。
- 與中國創業板及中小企股票有關的規則及規例在盈利能力及股本方面較適用於主板市場的規則及規例寬鬆。
- 鑑於中小企及在中國創業板市場上市的公司的新興性質，以及此等公司一般集中於科學發展、創新及媒體行業，該等公司涉及的科學發展過程如有任何失敗及／或有關行

業或其發展發生任何重大不利事件，均可能導致本基金投資的該等公司造成損失。

- 中小企及在中國創業板市場上市的公司有較少的盈利往績記錄。與主板上市公司相比，中小企或在中國創業板市場的上市公司可能較常及較快除牌。如本基金投資的公司除牌，可能對本基金造成不利影響。
- 若干中小企及在中國創業板上市的股票可能被估值過高並具有高市盈率的風險。該極高的估值未必能持續。此外，傳統估值方法因中小企及在中國創業板市場的上市公司所經營行業的風險性質而未必完全適用。中國創業板市場亦有較少的流通股份，故股價可能相對較易操控及在市場投機中可能出現較大波動。

7. 內地債務證券風險

- **波動性及流動性風險：**與發展較發達的市場比較，中國內地債務證券市場可能受較高波動性及較低流動性影響。在該等市場買賣的證券的價格或須承受波動。
- **對手方風險：**本基金須承受本基金可能投資的債務證券發行人的信貸／違責風險。
- **利率風險：**投資於本基金須承受利率風險。一般而言，利率下跌時，債務證券的價格則上升，而利率上升時，債務證券的價格則下跌。
- **評級調低風險：**債務工具或其發行人的信貸評級可能在其後被調低。倘若有關評級被調低，本基金的價值可能受到不利影響。基金管理人可能未必能出售被調低評級的債務工具。
- **信貸評級機構風險：**中國內地的信貸評估制度及在中國內地使用的評級方法，可能與其他市場所使用者不同。因此，中國內地評級機構所給予的信貸評級，未必可直接與其他國際評級機構所給予的評級比較。
- **與城投債相關的風險：**本基金可能投資於城投債。城投債由地方政府融資平台（「**地方政府融資平台**」）發行。該等債券通常不獲中國內地的地方政府或中央政府擔保。倘若地方政府融資平台拖欠支付城投債的本金或利息，本基金可能蒙受重大損失及基金資產淨值可能受到不利影響。
- **與資產支持證券相關的風險：**本基金可能投資於非常缺乏流動性及容易出現大幅價格波動的資產支持證券（包括資產支持商業票據）。與其他債務證券相比，該等工具可能承受較大的信貸、流動性及利率風險。該等工具經常承受延長及提前還款風險，以及相關資產未能履行付款義務的風險，因而可能對證券回報產生不利影響。

8. 巨額贖回風險

- 巨額贖回可能使基金管理人須迅速變現本基金的投資，而對本基金的資產淨值造成不利影響，在最壞的情況下，可能導致暫停或延遲贖回程序。根據中國內地法規，如發生持續巨額贖回的情況，贖回款項的支付或會被延遲不多於20個工作日。

9. 從資本中分派的風險

- 從上一個財政年度結轉的累計可分派收入淨額中支付的分派，相當於根據香港監管披露規定從資本中分派。投資者應注意，從資本中支付分派，相當於退還或提取投資者部分原本投資的金額或歸屬於該金額的資本收益。涉及從股份類別資本中支付股息的分派將導致有關單位的基金單位淨值即時減少。

10. 與回購／反向回購交易有關的風險

- 基金管理人可為本基金訂立回購交易。本基金可能因對手方違責令收回存放於對手方的抵押品的過程中遭延誤及困難，或原本收取的現金可能因為抵押品的估值不準確和

不足及市場走勢而少於存放於對手方的抵押品，而蒙受重大損失。

- 基金管理人亦可為本基金訂立反向回購交易。於銀行間市場進行的反向回購交易存放的抵押品未必按市值計價。此外，本基金進行反向回購交易時可能因於對手方違責後收回所存放現金或變現抵押品的過程中遭受延誤及困難，或出售抵押品所得款項可能因抵押品的估值不準確和不足及市場走勢而少於存放於對手方的現金，而蒙受重大損失。

11. 稅務及 FATCA 風險

- 投資者應注意，與投資於、持有或出售本基金的單位所產生的收入及收益的潛在稅務責任有關的稅務狀況及稅務風險的特定不確定因素。本基金的稅務規例及／或稅務撥備政策的變更僅會影響本基金當時的投資者。在該項變更前已出售或贖回其單位的投資者可能不受影響。視乎贖回單位產生的資本收益及本基金的分派會否及最終如何被徵稅，以及投資者何時投資於本基金，投資者可能得利或失利。有關中國內地稅收制度及 FATCA 的若干風險，於本文件「稅務」一節進一步詳述。

香港的交易及結算程序

就香港投資者而言，本基金的最低初始投資額、最低其後投資額、最低贖回額及最低持有量的詳情載述如下：

最低初始投資額	最低其後投資額	最低贖回額	最低持有量
人民幣 100 元	人民幣 100 元	100 個單位	100 個單位

就透過香港代表買賣單位而言，「香港交易日」指香港銀行亦開門經營正常銀行業務的開放日。若由於懸掛8號颱風訊號、黑色暴雨警告訊號或其他類似事件，導致香港銀行於任何日子的營業時段縮短，則該日不當作香港交易日，除非基金管理人另有決定，則作別論。「開放日」的定義是為基金投資者辦理基金單位申購、贖回或其他業務的「工作日」，而「工作日」的定義是上海證券交易所及深圳證券交易所的正常交易日。

在香港申購及贖回單位在每個香港交易日進行，惟在下文「資產淨值」一節「暫停估值及交易」分節所載暫停本基金單位估值及買賣的期間及本基金停止接受申購的期間除外。

香港代表認為屬不清晰或不完整的申購及贖回指示可導致有關指示的執行有所延誤。該等指示將只會在獲核實及確認令香港代表接納時才會執行。香港代表不會對就不清晰的指示引起的延誤而產生的任何損失負責。

申購程序

投資者如要購買本基金單位，應在香港交易日下午 3 時正（香港時間）（「交易截止時間」）前向認可分銷商或香港代表（如適用）提出申請以進行同日交易。認可分銷商須於下午 5 時正（香港時間）前將在交易截止時間前收到的有關申請轉交予香港代表以進行同日交易。

香港代表將合計直接從投資者及／或透過認可分銷商收到的申購申請，並將綜合指示交予基金

管理人。於交易截止時間後收到的申請將於緊隨的下一個香港交易日轉交予基金管理人。獲配發的單位數目將按申購款項（扣除申購費用）除以基金管理人收到申請的香港交易日的基金單位淨值計算。申購將在下一個香港交易日確認。

香港投資者可以傳真或由申請表格中指定的獲授權人士以電子通訊（如適用）透過香港代表作出單位申購。

不同認可分銷商對申購可能有不同的處理。就透過香港認可分銷商作出的申購申請而言，投資者應諮詢其各自的認可分銷商有關透過該等認可分銷商買賣所適用的交易程序（包括接受提交申購指示的方式）。認可分銷商可就接收申購申請實施不同的較早交易截止時間。投資者應留意有關認可分銷商的安排。

香港投資者不可轉換至本基金其他股份類別或任何其他投資基金。

贖回程序

香港基金單位持有人如欲要求贖回其於本基金持有的全部或任何部分單位，可在交易截止時間前向認可分銷商或香港代表（如適用）以既定格式提交其贖回指示以進行同日交易。認可分銷商須於下午5時正（香港時間）前將在交易截止時間前收到的有關申請轉交予香港代表以進行同日交易。

香港代表將合計直接從投資者及 / 或透過認可分銷商收到的贖回指示，並將綜合指示交予基金管理人。於交易截止時間後收到的申請將於緊隨的下一個香港交易日處理。單位將以基金管理人收到申請的香港交易日的基金單位淨值贖回。贖回將在下一個香港交易日確認。

香港投資者可以傳真或由贖回表格中指定的獲授權人士以電子通訊（如適用）透過香港代表作出單位贖回。

不同認可分銷商對贖回可能有不同的處理。投資者如要透過香港認可分銷商贖回單位，投資者應諮詢其各自的認可分銷商有關透過該等認可分銷商買賣所適用的交易程序（包括接受提交贖回指示的方式）。認可分銷商可就接收贖回申請實施不同的較早交易截止時間。投資者應留意有關認可分銷商的安排。

倘若在贖回基金單位持有人持有的H類基金單位後，於贖回之時或之後餘下單位的價值少於100個單位，則該贖回指示將被視為贖回基金單位持有人所持全部餘下單位的指示。換言之，餘下單位將被強制贖回，而處理此強制贖回將毋須經投資者同意或通知投資者。概無任何其他強制贖回情況。

結算

申購款項必須於申請時支付。付款必須以人民幣的已結清款項作出。

不應向並非依據《證券及期貨條例》第V部持牌或註冊進行第1類（證券交易）受規管活動的

任何香港中介人支付任何款項。

贖回所得款項將通常於香港代表收妥完成贖回所需文件後7個香港交易日內，透過電匯以人民幣支付予登記基金單位持有人。

謹請注意，贖回款項的支付可能因招募說明書「七、基金單位的申購、贖回和轉換」一節「(七) 暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形」分節所述的情況延遲。在此等情況下，支付贖回款項的延長時間應反映因特定情況而需要的額外時間，而贖回款項將在切實可行下盡快支付予基金單位持有人。在任何情況下，贖回款項將於基金管理人接受並確認贖回指示後20個工作日內支付。

所有支付贖回款項產生的銀行收費，將由進行贖回的基金單位持有人承擔。投資者應向認可分銷商或香港代表查詢進一步詳情。

就透過認可分銷商買賣單位的投資者，建議向有關分銷商索取結算的資料。

更改資料及反洗錢檢查

如基金單位持有人的申請表格所載資料或基金單位持有人的個人資料或詳情有任何變動，基金單位持有人應將任何有關更改以書面通知香港代表或有關認可分銷商（其將通知基金管理人），並向香港代表或有關認可分銷商提供香港代表或有關認可分銷商或基金管理人可能要求與該項更改有關的額外文件。

倘若延緩或未能提供核實身份或申購款項合法性所需的任何文件或資料，基金管理人、基金託管人、香港代表及 / 或有關認可分銷商可拒絕接受申請及有關該項申請的申購款項。此外，如基金單位持有人延緩或未能提供核實身份所需的任何文件或資料，基金管理人、基金託管人、香港代表及 / 或有關認可分銷商可延緩支付任何贖回款項，以及倘若彼等任何一方懷疑或獲通知(i)該付款可導致任何人士在任何相關司法管轄區觸犯或違反任何反洗黑錢法例或其他法律或法規；或(ii)有關拒絕付款乃確保遵從任何相關司法管轄區任何有關法律或法規所必要或適當，則可拒絕向基金單位持有人作出付款。

代名人安排及基金單位持有人會議

透過香港代表申購單位的香港投資者將透過香港代表的聯屬公司 — 摩根投資客戶服務（亞洲）有限公司（「代名人」）持有本基金單位。

香港代表已根據代名人協議之條款委任代名人，代香港投資者根據條款及條件持有單位，有關條款及條件概述如下：

- (i) 香港代表作為每位香港基金單位持有人的代理可：
 - a. 就由代名人代該香港基金單位持有人持有或將持有的單位發出任何出售或購入單位的指示；

- b. 在該香港基金單位持有人並無進一步指示下，指示代名人或本基金促使或導致就任何該等單位而已支付或應支付的任何股息或其他利益或贖回所得款項，直接支付予代表該香港基金單位持有人的香港代表。香港代表將根據有關香港基金單位持有人不時的指示而動用任何該等股息或所得款項。
- (ii) 在上文規限下，就代香港基金單位持有人賬戶持有的任何單位相關指示，將僅由香港代表以該香港基金單位持有人的代理身份向代名人作出。香港代表及代名人將分別根據由香港基金單位持有人及香港代表向其發出的任何指示行事，惟香港代表及代名人各自將須獲充份知會（通知期由香港代表絕對酌情決定）以使其按指示行事。
- (iii) 香港代表及其他有關各方（包括基金管理人），將就任何或彼等全部直接或間接因或就香港代表或代名人接納或依賴該香港基金單位持有人或代表該香港基金單位持有人作出或據稱作出或由香港代表作出之任何指示而面對、蒙受或產生之任何法律行動、訴訟、索償、損失、賠償、稅項、成本及開支，而獲各香港基金單位持有人彌償，惟香港代表或代名人（視情況而定）須秉誠行事，惟因香港代表或任何其他有關方故意失責、疏忽或欺詐的情況則除外。
- (iv) 各香港基金單位持有人須就代名人就代該香港基金單位持有人持有之任何單位而產生的任何稅項負責。

透過認可分銷商申購單位的香港投資者，應聯絡有關認可分銷商以了解適用的代名人安排的詳情。

代名人或各認可分銷商（視情況而定）將記錄其代為持有本基金單位的相關香港基金單位持有人。由於代名人安排，代名人或各認可分銷商（視情況而定）將於本基金的名冊記錄為持有人（「代名人賬戶持有人」）。相關香港基金單位持有人將不會記錄為有關單位的持有人。代名人或各認可分銷商（視情況而定）將有權行使作為單位持有人（而非個別相關香港基金單位持有人）的權利，包括但不限於表決權、對基金管理人及基金託管人採取法律行動的權利。

基金管理人將向代名人或認可分銷商（視情況而定）傳達所有基金單位持有人會議的詳情，例如會議日期、時間及與本基金有關的決議案；預期代名人或認可分銷商（視情況而定）將繼而在切實可行下盡快通知相關香港基金單位持有人相關詳情及投票安排。根據基金合同的條款及在不損害基金單位持有人利益的原則下，代名人或任何在香港的認可分銷商向H類基金單位的相關香港基金單位持有人提供服務。該等服務包括委派代表要求基金單位持有人會議、委派代表召開基金單位持有人會議、委派代表出席基金單位持有人會議、委派代表在基金單位持有人會議上投票等。代名人或認可分銷商（視情況而定）將整合相關香港基金單位持有人的投票指示，並向基金管理人提交該等投票指示。此等指示將根據基金合同的條文處理。

投資者必須遵從代名人或有關認可分銷商（視情況而定）所訂明的安排及截止時間，以參與基金單位持有人會議的投票過程。

香港投資者應注意，其透過此等代名人安排進行的投資與香港代表或基金管理人並無任何直接合約關係。儘管相關香港基金單位持有人乃單位的實益持有人，在法律上該等單位則由代名人

或有關認可分銷商（視情況而定）所擁有。在此等安排下，相關香港基金單位持有人與香港代表（香港單位持有人直接透過香港代表申購單位的情況除外）或基金管理人並無任何直接合約關係，因此香港基金單位持有人（香港單位持有人直接透過香港代表申購單位的情況除外）或基金管理人只可向代名人或有關認可分銷商（視情況而定）追究法律責任而不可直接向香港代表或基金管理人追究。

香港投資者應考慮上文並了解以代名人安排的方式持有單位的分別，尤其是香港投資者將透過代名人行使其於本基金的權利，而直接持有單位的中國內地投資者則有權對基金直接行使彼等的權利。

資產淨值

公佈基金單位淨值

基金單位淨值可於每個香港交易日在香港代表的網站www.jpmorganam.com.hk查閱。此網站並未經證監會審閱。

暫停估值及交易

本基金資產淨值的釐定及本基金單位的申購或贖回如有任何暫停，將於該決定後及在適用規例所規定的時限內，在切實可行下盡快在香港代表的網站www.jpmorganam.com.hk公佈。本基金如有任何交易暫停或延緩須通知中國證監會，證監會亦將相應獲得通知。

投資者應注意，上述網站並未經證監會審閱。

分派

請參閱招股說明書「十二、基金的收益與分配」一節以了解適用於 H 類基金單位的分派政策，惟 H 類基金單位持有人目前並不獲提供分派再投資（如有宣派）的選項則除外。再投資可供選擇時，投資者將獲得通知。

分派可從自上一個財政年度結轉的累計可分派收入淨額中派付，相當於根據香港監管披露規定從資本中分派。

投資者應注意，從資本中派付股息代表及相當於退還或提取部分原本投資的金額或歸屬於該金額的資本收益，並可能導致 H 類基金單位的價值即時減少，以及將降低該等 H 類基金單位的基金單位持有人的任何資本增值。

香港代表會應要求提供 H 類基金單位最近 12 個月*的分派組成成分（即從可分派收入淨額及資本支付的相對金額），有關資料亦在網站 www.jpmorganam.com.hk 提供。投資者應注意，上述網站並未經證監會審閱。

基金管理人可在獲得事先監管批准的情況下及給予基金單位持有人不少於一個月的事先通知後，修改有關從 H 類基金單位資本中支付分派的股息政策。

這指股份類別推出日期後的 12 個月滾動期。

費用及開支

準投資者應留意招募說明書「七、基金單位的申購、贖回和轉換」及「十三、基金的費用與稅收」各節所載有關本基金的費用及開支詳情。

申購H類基金單位須繳付一項最高達申購金額5%的申購費用。申購費用應付予有關認可分銷商或香港代表（視情況而定）。下文載有申購費用的說明範例以供參考：

範例：假設投資者投資人民幣 10,000 元以申購 H 類基金單位，適用的申購費用率為 5%，而於某香港交易日的基金單位淨值為人民幣 1.5 元，則將予配發的單位數目應按如下計算：

$$\text{申購費用} = (\text{人民幣 } 10,000 \text{ 元} \times 5\%) / (1+5\%) = \text{人民幣 } 476.19 \text{ 元}$$

$$\text{淨申購款項} = \text{人民幣 } 10,000 \text{ 元} - \text{人民幣 } 476.19 \text{ 元} = \text{人民幣 } 9,523.81 \text{ 元}$$

$$\text{申購單位數目} = \text{人民幣 } 9,523.81 \text{ 元} / \text{人民幣 } 1.5 \text{ 元} = 6,349.21 \text{ 個單位}$$

因此，在以上範例中，投資者投資人民幣 10,000 元可獲本基金 6,349.21 個 H 類基金單位。

贖回H類基金單位須繳付一項相當於贖回金額0.13%（最高：多達0.5%）的贖回費用。贖回費用應付予本基金。為免生疑問，不少於贖回費用總額25%的安排應計入本基金的財產，「七、基金單位的申購、贖回和轉換」一節所載並不適用於H類基金單位。

下文載有贖回費用的說明範例以供參考：

範例：假設投資者從本基金贖回 10,000 個單位，而於某香港交易日的基金單位淨值為人民幣 1.5 元，則將支付予投資者的贖回款項應按如下計算：

$$\text{贖回總額} = 10,000 \times \text{人民幣 } 1.5 \text{ 元} = \text{人民幣 } 15,000 \text{ 元}$$

$$\text{贖回費用} = \text{人民幣 } 15,000 \text{ 元} \times 0.13\% = \text{人民幣 } 19.5 \text{ 元}$$

$$\text{贖回款項淨額} = \text{人民幣 } 15,000 \text{ 元} - \text{人民幣 } 19.5 \text{ 元} = \text{人民幣 } 14,980.5 \text{ 元}$$

因此，在以上範例中，投資者進行的贖回收到人民幣 14,980.5 元。

稅務

投資者可參閱招募說明書以了解更多潛在稅務影響的資料。投資者應自行了解及在適當時，就根據其公民身份、居住地，或居駐或註冊成立所在國家的法律申購、購買、持有、轉換、贖回或以其他方式處置單位的可能稅務後果，諮詢其專業顧問。

中國內地

(A) 香港投資者於基金互認下的稅務

於 2015 年 12 月 18 日，財政部、國家稅務總局及中國證監會聯合發出《財稅[2015] 125 號》通知（「該通知」），其中規定香港投資者或於香港的投資者（「**香港投資者**」）投資於基金互認下的中國內地證券投資基金（「**認可內地基金**」）的中國內地稅務，並載列如下：

企業所得稅（「企業所得稅」）及個人所得稅（「個人所得稅」）

香港投資者（企業投資者或個人投資者）自出售認可內地基金收益的所得收入獲暫時豁免繳納所得稅（分別包括企業所得稅及個人所得稅）。香港投資者自認可內地基金分派的所得收入毋須再次繳納所得稅（分別包括企業所得稅及個人所得稅），原因為該等稅項於分派予認可內地基金時已由中國上市公司 / 債券發行人預扣。

營業稅（「營業稅」）

香港投資者自出售認可內地基金收益的所得收入獲暫時豁免繳納營業稅。

印花稅

香港投資者就申購、贖回、購買、出售、轉讓或繼承認可內地基金的單位 / 股份暫時毋須支付中國內地印花稅。

(B) 中國內地證券投資基金的稅務

根據《財稅[2008] 1 號》，買賣中國內地股份及債券變現的收益、中國內地股份的股息、中國內地債券的利息及由中國內地證券投資基金產生的其他收入，將獲暫時豁免繳納企業所得稅。

根據《財稅[2002] 128 號》，上市公司及債券發行人應自中國內地證券投資基金支付的股息或利息預扣 20% 個人所得稅。然而，香港投資者（企業投資者或個人投資者）就所宣派的股息及利息須分別按稅率 10% 及 7%（按預扣稅基準）繳納所得稅，該稅項將於中國內地發行人（作為預扣稅款代理人）向認可內地基金宣派香港投資者根據該通知應佔的股息及利息部分時繳納。

此外，出售 A 股及 B 股（「**內地股份**」）須按款項總額的稅率 0.1% 繳納中國內地印花稅。然而，購買內地股份毋須繳納中國印花稅。

中國內地政府近年已實行多項稅務改革政策，而現有稅務法律及法規日後可能予以修改或修訂。概不保證現行稅務豁免或優惠不會於日後被撤銷。投資者應就其投資於認可內地基金，對其中國內地稅務狀況自行尋求稅務意見。

香港

根據香港現行法律及慣例，預期本基金在其維持獲證監會認可的期間無須繳納其經營招募說明書及本香港說明文件所述的業務而產生的任何香港利得稅。除下文所述外，基金單位持有人將無須就本基金的分派或出售任何單位而變現的資本收益繳納任何香港稅項。

如購買及贖回單位是或構成在香港經營貿易、專業或業務的一部分，則有關基金單位持有人所變現的收益或須繳納香港利得稅。單位不須繳納香港遺產稅，而發行或轉讓單位將無須繳納香港印花稅。

外國賬戶稅收合規法案

1986 年美國國內收入法（「**美國國內收入法**」）（經修訂）第 1471 至 1474 節（稱為「**FATCA**」）就若干向非美國人士（例如：本基金）作出的付款（包括來自美國發行人證券的利息及股息，以及銷售該等證券的所得款項總額）實施規則。除非有關付款的收款人符合若干旨在令美國國家稅務局（「**美國國家稅務局**」）辨識在該等付款中擁有權益的美國人士（按美國國內收入法的涵義）的規定，否則可能須就所有有關付款按 30% 稅率繳付預扣稅。為避免就有關付款繳付預扣稅，海外金融機構（「**海外金融機構**」，如本基金）（以及一般為於美國境外組成的其他投資基金）一般將須與美國國家稅務局訂立協議（「**海外金融機構協議**」）。根據有關協議，海外金融機構同意識別屬美國人士的直接或間接擁有人，並向美國國家稅務局申報有關該等美國人士的若干資料。

一般而言，如海外金融機構並無簽訂海外金融機構協議或並非另行獲得豁免，該海外金融機構將就所有源自美國的「**可預扣付款**」，包括於 2014 年 7 月 1 日或之後作出的股息、利息及若干衍生性付款支付 30% 懲罰性預扣稅。此外，由 2019 年 1 月 1 日起，所得款項總額，例如來自產生美國來源股息或利息的股票及債務責任的銷售所得款項及本金返還，將被當作是「**可預扣付款**」。

由於意識到金融機構與美國國家稅務局簽訂海外金融機構協議可能存在法律問題，許多政府已經或將會與美國國家稅務局簽訂跨政府協議（「**跨政府協議**」）。截至本文件日期，中國內地政府尚未與美國簽訂跨政府協議，惟已實質上商討該協議，並獲列入被視為已設有版本一跨政府協議的「白表」國家。

截至本文件日期，基金管理人已在美國國家稅務局註冊登記為註冊視同合規金融機構（包括按版本一應申報的海外金融機構），並已取得其全球中介機構識別號碼。基金管理人擔任本基金的保薦實體。本基金將依賴基金管理人以遵從 FATCA。

基金管理人及本基金將盡力符合根據 FATCA 所施加的規定，以避免繳納任何預扣稅。倘若本基金未能遵從 FATCA 所施加的規定及本基金因不合規而須就其投資繳納美國預扣稅，則基金資產淨值或會受到不利影響及本基金因而可能蒙受重大損失。

每名基金單位持有人及準投資者應就 FATCA 對其本身的稅務情況下的潛在影響諮詢其本身稅務顧問。

報告

載有財務報表的經審核年報、未經審核半年度報告及季度報告，將根據招募說明書「**十五、基金的信息披露**」一節提供予每名基金單位持有人。年報將於每年度結束之日起計90日內提供。本基金的半年度報告將於每年上半年結束之日起計60日內提供。本基金的季度報告將每個季度結束之日起計15個工作日內提供。

向香港投資者提供的財務報告將根據基金互認安排規定（或證監會不時另行規定者）向香港投資者提供的有關額外資料而作出補充。

上述所有報告將以電子形式在www.jpmorganam.com.hk供基金單位持有人查閱。投資者應注意，上述網站並未經證監會審閱。此等報告可供查閱時，單位持有人將獲得通知。此等報告亦將在香港代表的註冊辦事處可供查閱。

供投資者查閱的文件

發售文件及本基金的持續資料披露，將同時供中國內地投資者及香港投資者查閱，惟僅就並無於香港提供及與香港投資者無關的本基金股份類別而發給中國內地投資者的任何通知，或對香港投資者並無影響的發行相關事項的任何通知，則屬例外。

下列文件的副本於平日（不包括星期六及公眾假期）正常辦公時間內在香港代表的註冊辦事處可供免費查閱：

- i. 中國證監會就本基金的發售發出的批准文件；
- ii. 本基金的基金合同（經不時修訂）；
- iii. 招募說明書所指的託管協議；
- iv. 向中國證監會註冊的本基金招募說明書、本香港說明文件及產品資料概要（經不時修訂）；
- v. 上文「**報告**」一節所述的本基金財務報告；
- vi. 法律意見（由中國內地律師發出）；
- vii. 香港代表協議；
- viii. 本基金的通知；

ix. 招募說明書所載將供公眾查閱的其他文件。

上文(i)、(iii)、(vi)及(ix)項將僅備有簡體中文版本。(ii)及(v)項將僅備有簡體中文及繁體中文版本。(iv)及(viii)項將僅備有英文及繁體中文版本。(vii)項將僅備有英文版本。

投資者可向香港代表提交書面要求索取有關(ii)及(v)項英文版本的特定資料。香港代表將在切實可行下盡快回應有關要求。

上文(iv)及(v)項所載文件的副本亦可在香港代表的註冊辦事處免費索取。上文所載的其他文件的副本可向香港代表的註冊辦事處支付合理費用後索取。

就(iv)項而言，本基金的招募說明書通常每六個月進行更新；而香港說明文件及產品資料概要將在必要時更新以反映有關更改。

招募說明書－2019年12月

上投摩根新興動力 混合型證券投資基金

內地與香港互認基金系列



基金管理人：

香港主銷售商：

上投摩根
基金管理

摩根
資產管理

上投摩根新興動力混合型證券投資基金

招募說明書(更新)

基金合同生效日期：2011年7月13日
基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
基金託管人：中國農業銀行股份有限公司

重要提示

- 1、 基金管理人保證本招募說明書的內容真實、準確、完整；
- 2、 本招募說明書經中國證監會核准，但中國證監會對本基金募集的核准，並不表明其對本基金的價值和收益作出實質性判斷或保證，也不表明投資於本基金沒有風險；
- 3、 投資有風險，投資人認購（或申購）基金時應當認真閱讀本招募說明書；
- 4、 基金的過往業績並不預示其未來表現；
- 5、 基金管理人依照恪盡職守、誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利，也不保證最低收益；
- 6、 本基金可以參加科創板股票的投資。基金資產投資於科創板股票，會面臨科創板機制下因投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險，包括但不限於流動性風險、退市風險、投資集中度風險、市場風險、系統性風險、股價波動風險、政策風險等。基金可根據投資策略需要或市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於科創板股票或選擇不將基金資產投資於科創板股票，基金資產並非必然投資於科創板股票。
- 7、 本招募說明書所載內容截止日為2019年10月31日，基金投資組合及基金業績的數據截止日為2019年9月30日。
- 8、 關於本基金H類基金單位的詳細信息及相關事項，應參照本基金的香港說明文件。本基金H類基金單位投資者，應將本招募說明書、本基金香港說明文件及H類基金單位產品資料概要一併閱讀。

二零一九年十二月

目錄

一、緒言.....	3
二、釋義.....	3
三、基金管理人.....	8
四、基金託管人.....	20
五、相關服務機構.....	23
六、基金的募集及基金合同的生效.....	35
七、基金單位的申購、贖回和轉換.....	36
八、基金的投資.....	46
九、基金的業績.....	59
十、基金的資產.....	61
十一、基金資產的估值.....	62
十二、基金的收益與分配.....	69
十三、基金的費用與稅收.....	71
十四、基金的會計與審計.....	73
十五、基金的信息披露.....	74
十六、風險披露.....	80
十七、基金合同的變更、終止與基金資產的清算.....	84
十八、基金合同的內容摘要.....	87
十九、基金託管協議的內容摘要.....	115
二十、對基金單位持有人的服務.....	128
二十一、其他應披露的事項.....	129
二十二、招募說明書的存放及查閱方式.....	129
二十三、備查文件.....	129

一、緒言

招募說明書依據《中華人民共和國證券投資基金法》和其他有關法律法規的規定，以及《上投摩根新興動力混合型證券投資基金基金合同》(以下簡稱「合同」或「基金合同」)編寫。

招募說明書闡述了上投摩根新興動力混合型證券投資基金(以下簡稱「本基金」或「基金」)的投資目標、策略、風險、費率等與投資人投資決策有關的全部必要事項，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀招募說明書。

基金管理人承諾本招募說明書不存在任何虛假內容、誤導性陳述或重大遺漏，並對其真實性、準確性、完整性承擔法律責任。本基金是根據本招募說明書所載明的資料申請募集的。本基金管理人沒有委託或授權任何其他人士提供未在本招募說明書中載明的信息，或對本招募說明書作任何解釋或者說明。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利，也不保證最低收益。基金根據招募說明書所載明資料發行。

本招募說明書依據基金合同編寫，並經中國證監會核准。基金合同是約定基金當事人之間權利義務的法律文件。招募說明書主要向投資者披露與本基金相關事項的信息，是投資者據以選擇及決定是否投資於本基金的要約邀請文件。基金投資者依照基金合同取得基金單位，即成為基金單位持有人和基金合同的當事人，其持有基金單位的行為本身即表明對基金合同的承認和接受，並按照《基金法》、基金合同及其他有關規定享有權利，承擔義務。

基金投資人欲了解基金單位持有人的權利和義務，應詳細查閱基金合同。

二、釋義

在本基金招募說明書中，除非文意另有所指，下列詞語或簡稱具有如下含義：

- 1、 基金或本基金：指上投摩根新興動力混合型證券投資基金
- 2、 基金管理人或本基金管理人：指上投摩根基金管理有限公司
- 3、 基金託管人或本基金託管人：指中國農業銀行股份有限公司
- 4、 基金合同：指《上投摩根新興動力混合型證券投資基金基金合同》及對該基金合同的任何有效修訂和補充
- 5、 託管協議或本託管協議：指基金管理人與基金託管人就本基金簽訂之《上投摩根新興動力混合型證券投資基金託管協議》及對該託管協議的任何有效修訂和補充

- 6、 招募說明書或本招募說明書：指《上投摩根新興動力混合型證券投資基金招募說明書》，及其更新
- 7、 基金單位發售公告：指《上投摩根新興動力混合型證券投資基金單位發售公告》
- 8、 法律法規：指中國現行有效並公佈實施的法律、行政法規、司法解釋、部門規章、地方性法規、地方政府規章及其他對基金合同當事人有約束力的規範性文件及對該等法律法規不時作出的修訂
- 9、 《基金法》：指2012年12月28日經第十一屆全國人民代表大會常務委員會第三十次會議修訂，自2013年6月1日起實施的《中華人民共和國證券投資基金法》及頒佈機關對其不時作出的修訂
- 10、 《銷售辦法》：指中國證監會2013年3月15日頒佈、同年6月1日實施的《證券投資基金銷售管理辦法》及頒佈機關對其不時作出的修訂
- 11、 《信息披露辦法》：指中國證監會2019年7月26日頒佈、同年9月1日實施的《公開募集證券投資基金信息披露管理辦法》及頒佈機關對其不時作出的修訂
- 12、 《運作辦法》：指《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及頒佈機關對其不時作出的修訂
- 13、 《流動性風險管理規定》：指中國證監會2017年8月31日頒佈、同年10月1日實施的《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》及頒佈機關對其不時作出的修訂
- 14、 中國：指中華人民共和國，就本基金合同而言，不包括香港特別行政區、澳門特別行政區和台灣地區
- 15、 中國證監會：指中國證券監督管理委員會
- 16、 銀行業監督管理機構：指中國銀行業監督管理委員會
- 17、 基金合同當事人：指受基金合同約束，根據基金合同享有權利並承擔義務的法律主體，包括基金管理人、基金託管人和基金單位持有人
- 18、 個人投資者：指符合法律法規規定的條件可以投資證券投資基金的自然人

- 19、 機構投資者：指符合法律法規規定可以投資證券投資基金的在中華人民共和國註冊登記或經政府有關部門批准設立的機構
- 20、 合格境外機構投資者：指符合《合格境外機構投資者境內證券投資管理辦法》及其他相關法律法規規定可投資中國證券的中國境外的機構投資者
- 21、 基金投資者：指個人投資者、機構投資者和合格境外機構投資者，以及法律法規或中國證監會允許購買證券投資基金的其他投資者
- 22、 基金單位持有人：指依招募說明書和基金合同合法取得基金單位的基金投資者
- 23、 基金銷售業務：指基金的宣傳推介、認購、申購、贖回、轉換、非交易過戶、轉託管及定期定額投資等業務
- 24、 銷售機構：指直銷機構和代銷機構
- 25、 直銷機構：指上投摩根基金管理有限公司
- 26、 代銷機構：指符合《銷售辦法》和中國證監會規定的其他條件，取得基金代銷業務資格並與基金管理人簽訂了基金銷售服務代理協議，代為辦理基金銷售業務的機構
- 27、 基金銷售網點：指直銷機構的直銷中心及代銷機構的代銷網點
- 28、 註冊登記業務：指基金登記、存管、過戶、清算和結算業務，具體內容包括基金投資者基金賬戶的建立和管理、基金單位註冊登記、基金銷售業務的確認、清算和結算、代理發放股息、建立並保管基金單位持有人名冊等
- 29、 註冊登記機構：指辦理註冊登記業務的機構。基金的註冊登記機構為上投摩根基金管理有限公司或接受上投摩根基金管理有限公司委託代為辦理註冊登記業務的機構
- 30、 基金賬戶：指註冊登記機構為基金投資者開立的、記錄其持有的、基金管理人所管理的基金單位餘額及其變動情況的賬戶
- 31、 基金交易賬戶：指銷售機構為基金投資者開立的、記錄基金投資者通過該銷售機構辦理交易業務而引起的基金單位的變動及結餘情況的賬戶

- 32、 基金合同生效日：指基金募集期結束後達到法律法規規定及基金合同約定的備案條件，基金管理人向中國證監會辦理基金備案手續完畢，並收到其書面確認的日期
- 33、 基金合同終止日：指基金合同規定的基金合同終止事由出現後，按照基金合同規定的程序終止基金合同的日期
- 34、 基金募集期限：指自基金單位發售之日起至發售結束之日止的期間，最長不得超過3個月
- 35、 存續期：指基金合同生效至終止之間的不定期限
- 36、 工作日：指上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日
- 37、 日：指公曆日
- 38、 月：指公曆月
- 39、 T日：指銷售機構在規定時間受理基金投資者有效申請工作日
- 40、 T + n日：指自T日起第n個工作日（不包含T日）
- 41、 開放日：指為基金投資者辦理基金單位申購、贖回或其他業務的工作日
- 42、 交易時間：指開放日基金接受申購、贖回或其他交易的時間段
- 43、 認購：指在基金募集期間，基金投資者申請購買基金單位的行為
- 44、 申購：指在基金存續期內，基金投資者申請購買基金單位的行為
- 45、 贖回：指在基金存續期內基金單位持有人按基金合同規定的條件要求賣出基金單位的行為
- 46、 基金轉換：指基金單位持有人按照本基金合同和基金管理人屆時的公告在本基金單位與基金管理人管理的其他基金單位間的轉換行為
- 47、 轉託管：指基金單位持有人在本基金的不同銷售機構之間實施變更所持基金單位銷售機構的操作

- 48、巨額贖回：本基金單個開放日，基金淨贖回申請（贖回申請單位總數加上基金轉換中轉出申請單位總數後扣除申購申請單位總數及基金轉換中轉入申請單位總數後的餘額）超過上一日基金單位總數的10%的情形
- 49、元：指人民幣元
- 50、基金收益：指基金利息收入、投資收益、公允價值變動收益和其他收入扣除相關費用後的餘額
- 51、基金資產總值：指基金擁有的各類有價證券、銀行存款本息、基金應收申購款及其他資產的價值總和
- 52、基金資產淨值：指基金資產總值減去基金負債後的淨資產值
- 53、基金單位淨值：指計算日基金資產淨值除以計算日基金單位總數的數值
- 54、基金資產估值：指計算評估基金資產和負債的價值，以確定基金資產淨值和基金單位淨值的過程
- 55、流動性受限資產：指由於法律法規、監管、合同或操作障礙等原因無法以合理價格予以變現的資產，包括但不限於到期日在10個交易日以上的逆回購與銀行定期存款（含協定約定有條件提前支取的銀行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公開發行股票、資產支持證券、因發行人債務違約無法進行轉讓或交易的債券等
- 56、基金單位分類：本基金根據基金銷售地及申購贖回費率的不同，將基金單位分為不同的股份類別。兩類基金單位分設不同的基金代碼，並分別公佈基金單位淨值。
- 57、A類基金單位：僅在中國大陸地區銷售，並收取申購和贖回費用的基金單位
- 58、H類基金單位：僅在中國香港地區銷售，並收取申購和贖回費用的基金單位
- 59、指定媒體：指中國證監會指定的用以進行信息披露的報刊、基金管理人、基金託管人的互聯網網站及其他媒體
- 60、《業務規則》：指《上投摩根基金管理有限公司開放式基金業務規則》，是規範基金管理人所管理的開放式證券投資基金註冊登記方面的業務規則

- 61、 不可抗力：指本基金合同當事人不能預見、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金託管人簽署之日後發生的，使本基金合同當事人無法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限於洪水、地震及其他自然災害、戰爭、騷亂、火災、政府徵用、沒收、法律法規變化、突發停電或其他突發事件、證券交易所非正常暫停或停止交易

三、基金管理人

(一) 基金管理人概況

本基金的基金管理人為上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區富城路99號震旦國際大樓25樓

辦公地址：中國（上海）自由貿易試驗區富城路99號震旦國際大樓25樓

法定代表人：陳兵

總經理：王大智

成立日期：2004年5月12日

實繳註冊資本：貳億伍仟萬元人民幣

股東名稱、股權結構及持股比例：

上海國際信託有限公司	51%
------------	-----

JPMorgan Asset Management (UK) Limited	49%
--	-----

上投摩根基金管理有限公司是經中國證監會證監基字[2004]56號文批准，於2004年5月12日成立的合資基金管理公司。2005年8月12日，基金管理人完成了股東之間的股權變更事項。公司註冊資本保持不變，股東及出資比例分別由上海國際信託有限公司67%和摩根資產管理（英國）有限公司33%變更為目前的51%和49%。

2006年6月6日，基金管理人的名稱由「上投摩根富林明基金管理有限公司」變更為「上投摩根基金管理有限公司」，該更名申請於2006年4月29日獲得中國證監會的批准，並於2006年6月2日在國家工商總局完成所有變更相關手續。

2009年3月31日，基金管理人的註冊資本金由一億五千萬元人民幣增加到二億五千萬元人民幣，公司股東的出資比例不變。該變更事項於2009年3月31日在國家工商總局完成所有變更相關手續。

基金管理人無任何受處罰記錄。

(二) 主要人員情況

1、 董事會成員基本情況：

董事長：陳兵

博士研究生，高級經濟師。

曾任上海浦東發展銀行大連分行資金財務部總經理，上海浦東發展銀行總行資金財務部總經理助理，上海浦東發展銀行總行個人銀行總部管理會計部、財富管理部總經理，上海國際信託有限公司副總經理兼董事會秘書，上海國際信託有限公司黨委副書記、總經理。

現任上海國際信託有限公司黨委書記、總經理；上投摩根基金管理有限公司董事長。

董事：Paul Bateman

大學本科學位。

曾任Chase Fleming Asset Management Limited全球總監、摩根資產管理全球投資管理業務行政總裁。

現任摩根資產管理全球主席、資產管理營運委員會成員及投資委員會成員。

董事：Daniel J. Watkins

學士學位。

曾任歐洲業務副首席執行官、摩根資產歐洲業務首席運營官、全球投資管理運營總監、歐洲運營總監、歐洲註冊登記業務總監、盧森堡運營總監、歐洲註冊登記業務及倫敦投資運營經理、富林明投資運營團隊經理等職務。

現任摩根資產管理亞洲業務首席執行官、資產管理運營委員會成員、集團亞太管理團隊成員。

董事：Richard Titherington

牛津大學政治、哲學和經濟碩士學位。

曾任摩根資產管理環球新興市場股票投資部總監。

現任摩根資產管理董事總經理、新興市場及亞太股票組別投資總監。

董事：王大智

學士學位。

曾任摩根資產管理香港及中國基金業務總監、摩根投信董事長暨摩根資產管理集團台灣區負責人。

現任上投摩根基金管理有限公司總經理。

董事：潘衛東

碩士研究生，高級經濟師。

曾任上海市金融服務辦公室金融機構處處長(掛職)、上海國際集團有限公司副總裁、上海國際信託有限公司黨委書記。

現任上海浦東發展銀行股份有限公司副行長、上海國際信託有限公司董事長。

董事：陳海寧

研究生學歷、經濟師。

曾任上海浦東發展銀行金融部總經理助理、公投總部貿易融資部總經理、武漢分行副行長、武漢分行黨委書記、行長。

現任上海浦東發展銀行總行資產負債管理部總經理兼任總行戰略發展部總經理。

董事：丁蔚

碩士研究生。

曾就職於中國建設銀行上海分行個人銀行業務部副總經理，上海浦東發展銀行個人銀行總部銀行卡部總經理，個人銀行總部副總經理兼銀行卡部總經理。

現任上海浦東發展銀行總行零售業務部總經理。

獨立董事：俞樵

經濟學博士。

現任清華大學公共管理學院經濟與金融學教授及公共金融與治理中心主任。曾經在加里伯利大學經濟系、新加坡國立大學經濟系、復旦大學金融系等單位任教。

獨立董事：劉紅忠

國際金融系經濟學博士。

現任復旦大學經濟學院教授，復旦大學金融研究中心副主任；同時兼任華泰證券股份有限公司、上海農村商業銀行股份有限公司、申銀萬國期貨有限責任公司、東海期貨有限責任公司及興業證券股份有限公司獨立董事、上海建工集團股份有限公司外部董事。

獨立董事：戴立寧

獲台灣大學法學碩士及美國哈佛大學法學碩士學位。

曾任台灣財政部常務次長，東吳大學法學院副教授。

現任北京大學法學院及光華管理學院兼職教授。

獨立董事：汪棣

美國加州大學洛杉磯分校金融專業工商管理碩士學位，並先後獲得美國加州註冊會計師執照及中國註冊會計師證書。

曾擔任普華永道金融服務部合夥人及普華永道中國投資管理行業主管合夥人。

現擔任招商證券股份有限公司、復星聯合健康保險股份有限公司、亞太財產保險有限公司及51信用卡有限公司獨立董事、中國台灣旭昶生物科技股份有限公司監事。

2、 監事會成員基本情況：

監事會主席：趙崢嶸

碩士學位，高級經濟師。

歷任工商銀行溫州分行副行長、浦發銀行溫州分行副行長、行長及杭州分行行長等職務。現任上海國際信託有限公司監事長、黨委副書記。

監事：梁斌

學士學位。

曾在高偉紳律師事務所（香港）任職律師多年。

現任摩根大通集團中國法律總監。

監事：張軍

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部總監、基金經理、投資組合管理部總監、投資績效評估總監、國際投資部總監、組合基金投資部總監。

現任上投摩根基金管理有限公司投資董事，管理上投摩根亞太優勢混合型證券投資基金、上投摩根全球天然資源混合型證券投資基金和上投摩根全球多元配置證券投資基金(QDII)。

監事：萬雋宸

曾任上海國際集團有限公司高級法務經理，上投摩根基金管理有限公司首席風險官，尚騰資本管理有限公司董事。

現任尚騰資本管理有限公司總經理。

3、 總經理基本情況：

王大智先生，總經理

學士學位。

曾任摩根資產管理香港及中國基金業務總監、摩根投信董事長暨摩根資產管理集團台灣區負責人。

4、 其他高級管理人員情況：

楊紅女士，副總經理

畢業於同濟大學，獲技術經濟與管理博士

曾任招商銀行上海分行稽核監督部業務副經理、營業部副經理兼工會主席、零售銀行部副總經理、消費信貸中心總經理；曾任上海浦東發展銀行上海分行個人信貸部總經理、個人銀行發展管理部總經理、零售業務管理部總經理。

杜猛先生，副總經理

畢業於南京大學，獲經濟學碩士學位。

歷任天同證券、中原證券、國信證券、中銀國際研究員；上投摩根基金管理有限公司行業專家、基金經理助理、基金經理、總經理助理／國內權益投資一部總監兼資深基金經理。

孫芳女士，副總經理

畢業於華東師範大學，獲世界經濟學碩士學位。

歷任華寶興業基金研究員；上投摩根基金管理有限公司行業專家、基金經理助理、研究部副總監、基金經理、總經理助理／國內權益投資二部總監兼資深基金經理。

郭鵬先生，副總經理

畢業於上海財經大學，獲企業管理碩士學位。

歷任上投摩根基金管理有限公司市場經理、市場部副總監，產品及客戶行銷部總監、市場部總監兼互聯網金融部總監、總經理助理。

張軍先生，副總經理。

畢業於同濟大學，獲管理工程碩士學位。

歷任中國建設銀行上海市分行辦公室秘書、公司業務部業務科科長、徐匯支行副行長、個人金融部副總經理，並曾擔任上投摩根基金管理有限公司總經理助理一職。

鄒樹波先生，督察長。

獲管理學學士學位。

曾任天健會計師事務所高級項目經理，上海證監局主任科員，上投摩根基金管理有限公司監察稽核部副總監、監察稽核部總監。

5、 本基金基金經理

基金經理杜猛先生，南京大學經濟學碩士，先後任職於天同證券、中原證券、國信證券和中銀國際證券，任研究員。2007年10月起加入上投摩根基金管理有限公司，先後擔任行業專家、基金經理助理、基金經理、總經理助理／國內權益投資一部總監兼資深基金經理，現擔任副總經理兼投資總監。2011年7月起擔任上投摩根新興動力混合型證券投資基金基金經理，自2013年3月至2015年9月同時擔任上投摩根智選30混合型證券投資基金基金經理，自2013年5月至2014年12月同時擔任上投摩根成長動力混合型證券投資基金基金經理，2014年12月至2019年4月同時擔任上投摩根內需動力混合型證券投資基金基金經理，2019年3月起同時擔任上投摩根中國優勢證券投資基金基金經理。

6、 基金管理人投資決策委員會成員的姓名和職務

杜猛，副總經理兼投資總監；孫芳，副總經理兼投資副總監；黃棟，量化投資部總監兼高級基金經理；張軍，投資董事、國際投資部總監、投資績效評估總監兼高級基金經理；朱曉龍，研究部總監兼基金經理；陳圓明，絕對收益投資部總監兼基金經理；聶曙光，債券投資部總監兼資深基金經理；孟晨波，總經理助理／貨幣市場投資部總監兼資深基金經理；任翔，基金經理兼固收研究部總監；鐘維倫，資深投資經理；劉凌雲，組合基金投資部總監兼基金經理；張文峰，組合基金投資部副總監兼投資經理；孟鳴，基金經理兼資深投資組合經理；葉承燾，投資經理；陳晨，投資經理。

上述人員之間不存在近親屬關係。

(三) 基金管理人的職責

- 1、 依法募集基金，辦理或者委託經國務院證券監督管理機構認定的其他機構代為辦理基金單位的發售、申購、贖回和登記事宜；
- 2、 辦理基金備案手續；
- 3、 對所管理的不同基金資產分別管理、分別記賬，進行證券投資；
- 4、 按照基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金單位持有人分配收益；
- 5、 進行基金會計核算並編製基金財務會計報告；
- 6、 編製中期和年度基金報告；
- 7、 計算並公告基金淨值信息，確定基金單位申購、贖回價格；
- 8、 辦理與基金資產管理業務活動有關的信息披露事項；
- 9、 召集基金單位持有人大會；
- 10、 保存基金資產管理業務活動的記錄、賬冊、報表和其他相關資料；
- 11、 以基金管理人名義，代表基金單位持有人利益行使訴訟權利或者實施其他法律行為；
- 12、 國務院證券監督管理機構規定的其他職責。

(四) 基金管理人承諾

- 1、 基金管理人將根據基金合同的規定，按照招募說明書列明的投資目標、策略及限制全權處理本基金的投資。
- 2、 基金管理人不得從事違反《中華人民共和國證券法》(以下簡稱：《證券法》)及其他有關法律法規的行為，並建立健全內部控制制度，採取有效措施，防止違反《證券法》及其他有關法律法規行為的發生。

- 3、 基金管理人不得從事下列違反《基金法》的行為，並建立健全內部控制制度，採取有效措施，防止法律法規規定的禁止行為的發生：
- (1) 投資於其他基金，但是國務院另有規定的除外；
 - (2) 違反基金單位持有人的利益，將基金資產用於向第三人抵押、擔保、資金拆借或者貸款，按照國家有關規定進行融資擔保的除外；
 - (3) 從事有可能使基金承擔無限責任的投資；
 - (4) 從事證券承銷行為；
 - (5) 將基金資產投資於與基金託管人或基金管理人有重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券；
 - (6) 違反證券交易業務規則，操縱和擾亂市場價格；
 - (7) 違反法律法規而損害基金單位持有人利益的；
 - (8) 法律、法規及監管機關規定禁止從事的其他行為。
- 4、 基金管理人將加強人員管理，強化職業操守，督促和約束員工遵守國家有關法律、法規及行業規範，誠實信用、勤勉盡責，不從事以下行為：
- (1) 越權或違規經營；
 - (2) 違反基金合同或基金託管協議；
 - (3) 故意損害基金單位持有人或其他基金相關機構的合法利益；
 - (4) 在向中國證監會報送的材料中弄虛作假；
 - (5) 拒絕、干擾、阻撓或嚴重影響中國證監會依法監管；
 - (6) 疏忽職守、濫用職權；
 - (7) 洩露在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密、尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等信息；
 - (8) 違反證券交易場所業務規則，擾亂市場秩序；

- (9) 在公開信息披露中故意含有虛假、誤導、欺詐成分；
- (10) 其他法律法規以及中國證監會禁止的行為。

5、 基金經理承諾

- (1) 依照有關法律法規和基金合同的規定，本着謹慎的原則為基金單位持有人謀取最大利益；
- (2) 不利用職務之便為自己、代理人、代表人、受僱人或任何其他第三人謀取不當利益；
- (3) 不洩露在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密、尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等信息；
- (4) 不以任何形式為其他組織或個人進行證券交易。

(五) 內部控制制度：

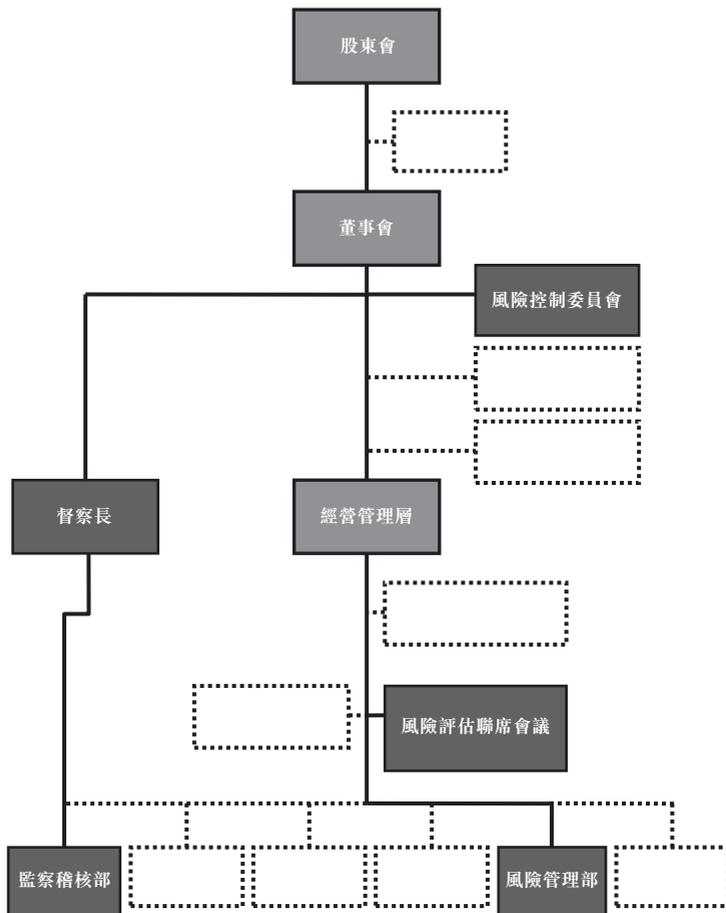
1、 內部控制的原則：

基金管理人內部控制遵循以下原則：

- (1) 健全性原則。內部控制應當包括基金管理人的各項業務、各個部門或機構和各級人員，並涵蓋到決策、執行、監督、反饋等各個環節。
- (2) 有效性原則。通過科學的內部控制手段和方法，建立合理的內部控制程序，維護內部控制制度的有效執行。
- (3) 獨立性原則。基金管理人各機構、部門和崗位職責應當保持相對獨立，基金管理人基金資產、自有資產、其他資產的運作應當分隔。
- (4) 相互制約原則。基金管理人內部部門和崗位的設置應當權責分明、相互制衡。
- (5) 成本效益原則。基金管理人運用科學化的經營管理方法降低運作成本，提高經濟效益，以合理的控制成本達到最佳的內部控制效果。

- 2、 制定內部控制制度應當遵循以下原則：
 - (1) 合法合規性原則。基金管理人內部控制制度應當符合國家法律、法規、規章和各項規定。
 - (2) 全面性原則。內部控制制度應當涵蓋基金管理人經營管理的各個環節，不得留有制度上的空白或漏洞。
 - (3) 審慎性原則。制定內部控制制度應當以審慎經營、防範和化解風險為出發點。
 - (4) 適時性原則。內部控制制度的制定應當隨着有關法律法規的調整和基金管理人經營策略、經營方針、經營理念等內外部環境的變化進行及時的修改或完善。
- 3、 基金管理人關於內部合規控制聲明書：
 - (1) 基金管理人承諾以上關於內部控制的披露真實、準確；
 - (2) 基金管理人承諾根據市場的變化和基金管理人的發展不斷完善內部合規控制。
- 4、 風險管理體系：
 - (1) 董事會下設風險控制委員會，主要負責基金管理人風險管理策略和控制政策、協調突發重大風險等事項。
 - (2) 董事會下設督察長，負責對基金管理人各業務環節合法合規運作的監督檢查和基金管理人內部稽核監控工作，並可向基金管理人董事會和中國證監會直接報告。
 - (3) 經營管理層下設風險評估聯席會議，進行各部門管理程序的風險確認，評估成員包括經營管理層、督察長、稽核、風險管理、基金投資、基金運作等各部門主管。風險評估聯席會議對各類風險予以事先充分的評估和防範，並進行及時控制和採取應急措施。
 - (4) 監察稽核部負責基金管理人各部門的風險控制檢查，定期不定期對業務部門內部控制制度執行情況和遵循國家法律法規及其他規定的執行情況進行檢查，並適時提出修改建議。

- (5) 風險管理部負責投資限制指標體系的設定和更新，對於違反指標體系的投資進行監查和風險控制的評估。
- (6) 風險管理部負責協助各部門修正、修訂內部控制操作制度，並對各部門的日常操作，依風險管理的考評，定期或不定期對各項風險指標進行控管，並提出內部控制建議。



四、基金託管人

(一) 基金託管人情況

1、 基本情況	
名稱：	中國農業銀行股份有限公司(簡稱中國農業銀行)
住所：	北京市東城區建國門內大街69號
辦公地址：	北京市西城區復興門內大街28號凱晨世貿中心東座
法定代表人：	周慕冰
成立日期：	2009年1月15日
批准設立機關和批准設立文號：	中國銀監會銀監復[2009]13號
基金託管業務批准文號：	中國證監會證監基金字[1998]23號
註冊資本：	34,998,303.4萬元人民幣
存續期間：	持續經營
聯絡電話：	010-66060069
傳真：	010-68121816
聯絡人：	賀倩

中國農業銀行股份有限公司是中國金融體系的重要組成部分，總行設在北京。經國務院批准，中國農業銀行整體改制為中國農業銀行股份有限公司並於2009年1月15日依法成立。中國農業銀行股份有限公司承繼原中國農業銀行全部資產、負債、業務、機構網點和員工。中國農業銀行網點遍佈中國城鄉，成為國內網點最多、業務輻射範圍最廣，服務領域最廣，服務對象最多，業務功能齊全的大型國有商業銀行之一。在海外，中國農業銀行同樣通過自己的努力贏得了良好的信譽，每年位居《財富》世界500強企業之列。作為一家城鄉並舉、聯通國際、功能齊備的大型國有商業銀行，中國農業銀行一貫秉承以客戶為中心的經營理念，堅持審慎穩健經營、可持續發展，立足縣域和城市兩大市場，實施差異化競爭策略，着力打造「伴你成長」服務品牌，依託覆蓋全國的分支機構、龐大的電子化網絡和多元化的金融產品，致力為廣大客戶提供優質的金融服務，與廣大客戶共創價值、共同成長。

中國農業銀行是中國第一批開展託管業務的國內商業銀行，經驗豐富，服務優質，業績突出，2004年被英國《全球託管人》評為中國「最佳託管銀行」。2007年中國農業銀行通過了美國SAS70內部控制審計，並獲得無保留意見的SAS70審計報告。自2010年起中國農業銀行連續通過託管業務國際內控標準(ISAE3402)

認證，表明了獨立公正第三方對中國農業銀行託管服務運作流程的風險管理、內部控制的健全有效性的全面認可。中國農業銀行着力加強能力建設，品牌聲譽進一步提升，在2010年首屆「『金牌理財』TOP10頒獎盛典」中成績突出，獲「最佳託管銀行」獎。2010年再次榮獲《首席財務官》雜誌頒發的「最佳資產託管獎」。2012年榮獲第十屆中國財經風雲榜「最佳資產託管銀行」稱號；2013年至2017年連續榮獲上海清算所授予的「託管銀行優秀獎」和中央國債登記結算有限責任公司授予的「優秀託管機構獎」稱號；2015年、2016年榮獲中國銀行業協會授予的「養老金業務最佳發展獎」稱號；2018年榮獲中國基金報授予的公募基金20年「最佳基金託管銀行」獎；2019年榮獲證券時報授予的“2019年度資產託管銀行天璣獎”稱號。

中國農業銀行證券投資基金託管部於1998年5月經中國證監會和中國人民銀行批准成立，目前內設綜合管理部、業務管理部、客戶一部、客戶二部、客戶三部、客戶四部、風險合規部、產品研發與信息技術部、營運一部、營運二部、市場營銷部、內控監管部、賬戶管理部，擁有先進的安全防範設施和基金託管業務系統。

2、 主要人員情況

中國農業銀行託管業務部現有員工近310名，其中具有高級職稱的專家60名，服務團隊成員專業水平高、業務質素好、服務能力強，高級管理層均有20年以上金融從業經驗和高級技術職稱，精通國內外證券市場的運作。

3、 基金託管業務經營情況

截至2019年9月30日，中國農業銀行託管的封閉式證券投資基金和開放式證券投資基金共486隻。

(二) 基金託管人的內部風險控制制度說明

1、 內部控制目標

嚴格遵守國家有關託管業務的法律法規、行業監管規章和行內有關管理規定，守法經營、規範運作、嚴格監察，確保業務的穩健運行，保證基金資產的安全完整，確保有關信息的真實、準確、完整、及時，保護基金單位持有人的合法權益。

2、 內部控制組織結構

風險管理委員會總體負責中國農業銀行的風險管理與內部控制工作，對託管業務風險管理和內部控制工作進行監督和評價。託管業務部專門設置了風險管理處，配備了專職內部控制監督人員負責託管業務的內部控制監督工作，獨立行使監督稽核職權。

3、 內部控制制度及措施

具備系統、完善的制度控制體系，建立了管理制度、控制制度、崗位職責、業務操作流程，可以保證託管業務的規範操作和順利進行；業務人員具備從業資格；業務管理實行嚴格的覆核、審核、檢查制度，授權工作實行集中控制，業務印章按規程保管、存放、使用，賬戶資料嚴格保管，制約機制嚴格有效；業務操作區專門設置，封閉管理，實施音像監控；業務信息由專職信息披露人負責，防止泄密；業務實現自動化操作，防止人為事故的發生，技術系統完整、獨立。

(三) 基金託管人對基金管理人運作基金進行監督的方法和程序

基金託管人通過參數設置將《基金法》、《運作辦法》、基金合同、託管協議規定的投資比例和禁止投資品種輸入監控系統，每日登錄監控系統監督基金管理人的投資運作，並通過基金資金賬戶、基金管理人的投資指令等監督基金管理人的其他行為。

當基金出現異常交易行為時，基金託管人應當針對不同情況進行以下方式的處理：

- 1、 電話提示。對媒體和輿論反映集中的問題，電話提示基金管理人；
- 2、 書面警示。對本基金投資比例接近超標、資金頭寸不足等問題，以書面方式對基金管理人進行提示；
- 3、 書面報告。對投資比例超標、結算資金透支以及其他涉嫌違規交易等行為，書面提示有關基金管理人並報中國證監會。

五、相關服務機構

(一) 基金銷售機構：

- 1、 直銷機構：上投摩根基金管理有限公司(同上)
- 2、 A類基金單位代銷機構：
 - (1) 中國建設銀行股份有限公司
住所：北京市西城區金融大街25號
辦公地址：北京市西城區鬧市口大街1號院1號樓
法定代表人：田國立
客戶服務電話：95533
網址：www.ccb.com
 - (2) 中國工商銀行股份有限公司
註冊地址：北京市西城區復興門內大街55號
法定代表人：陳四清
客戶服務統一諮詢電話：95588
網址：www.icbc.com.cn
 - (3) 中國農業銀行股份有限公司
住所：北京市東城區建國門內大街69號
辦公地址：北京市東城區建國門內大街69號
法定代表人：周慕冰
客戶服務電話：95599
網址：www.abchina.com
 - (4) 中國銀行股份有限公司
地址：北京市西城區復興門內大街1號
辦公地址：北京市西城區復興門內大街1號
法定代表人：劉連舸
客戶服務電話：95566
網址：www.boc.cn
 - (5) 招商銀行股份有限公司
註冊地址：廣東省深圳市福田區深南大道7088號
辦公地址：廣東省深圳市福田區深南大道7088號
法人代表：李建紅
客戶服務中心電話：95555
網址：www.cmbchina.com
 - (6) 交通銀行股份有限公司
註冊地址：上海市銀城中路188號
辦公地址：上海市銀城中路188號
法定代表人：彭純
客戶服務熱線：95559
網址：www.bankcomm.com

- (7) 上海浦東發展銀行股份有限公司
註冊地址：上海市浦東新區浦東南路 500 號
辦公地址：上海市中山東一路 12 號
法定代表人：高國富
客戶服務熱線：95528
網址：www.spdb.com.cn
- (8) 興業銀行股份有限公司
註冊地址：福州市湖東路 154 號
法定代表人：高建平
客戶服務電話：95561
網址：www.cib.com.cn
- (9) 上海銀行股份有限公司
註冊地址：上海市浦東新區銀城中路 168 號
辦公地址：上海市浦東新區銀城中路 168 號
法定代表人：金煜
客戶服務熱線：95594
網址：www.bankofshanghai.com
- (10) 中國光大銀行股份有限公司
註冊地址：北京市西城區復興門外大街 6 號光大大廈
法定代表人：李曉鵬
客戶服務電話：95595
網址：www.cebbank.com
- (11) 中信銀行股份有限公司
註冊地址：北京市東城區朝陽門北大街 9 號
法定代表人：李慶萍
24 小時客戶服務熱線：95558
網址：www.citicbank.com
- (12) 中國民生銀行股份有限公司
註冊地址：北京市西城區復興門內大街 2 號
法定代表人：洪崎
24 小時客戶服務熱線：95568
網址：www.cmbc.com.cn
- (13) 華夏銀行股份有限公司
註冊地址：北京市東城區建國門內大街 22 號
辦公地址：北京市東城區建國門內大街 22 號
法定代表人：李民吉
客戶諮詢電話：95577
網址：www.hxb.com.cn

- (14) 北京銀行股份有限公司
註冊地址：北京市西城區金融大街甲 17 號首層
辦公地址：北京市西城區金融大街丙 17 號
法定代表人：張東寧
客戶服務電話：95526
公司網站：www.bankofbeijing.com.cn
- (15) 寧波銀行股份有限公司
註冊地址：寧波市鄞州區寧東路 345 號
法定代表人：陸華裕
客戶服務統一諮詢電話：95574
網址：www.nbc.com.cn
- (16) 平安銀行股份有限公司
註冊地址：深圳市羅湖區深南東路 5047 號
辦公地址：深圳市羅湖區深南東路 5047 號
法定代表人：謝永林
客戶服務統一諮詢電話：95511 轉 3
網址：www.bank.pingan.com
- (17) 東莞農村商業銀行股份有限公司
地址：廣東省東莞市東城區鴻福東路 2 號
法定代表人：王耀球
客服電話：961122
網址：www.drcbank.com
- (18) 上海農村商業銀行股份有限公司
地址：中山東二路 70 號上海農商銀行大廈
法定代表人：冀光恒
門戶網站：www.srcb.com
客戶服務電話：021-962999
- (19) 南京銀行股份有限公司
辦公地址：南京市玄武區中山路 288 號
法定代表人：胡升榮
客戶服務電話：95302
網站：www.njcb.com.cn
- (20) 申萬宏源證券有限公司
註冊地址：上海市徐匯區長樂路 989 號 45 層
辦公地址：上海市徐匯區長樂路 989 號 45 層（郵編：200031）
法定代表人：李梅
客戶服務電話：95523
網址：www.swhysc.com

- (21) 申萬宏源西部證券有限公司
註冊地址：新疆烏魯木齊市高新區（新市區）北京南路358號大成國際大廈20樓2005室
辦公地址：新疆烏魯木齊市高新區（新市區）北京南路358號大成國際大廈20樓2005室（郵編：830002）
法定代表人：李琦
電話：010-88085858
傳真：010-88085195 客戶服務電話：400-800-0562
網址：www.hysec.com
- (22) 上海證券有限責任公司
註冊地址：上海市黃浦區四川中路213號久事商務大廈7樓
辦公地址：上海市黃浦區四川中路213號久事商務大廈7樓
法定代表人：李俊傑
客戶服務電話：021-962518
網址：www.shzq.com
- (23) 國泰君安證券股份有限公司
註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區商城路618號
辦公地址：上海市靜安區新閘路669號博華大廈21樓
法定代表人：楊德紅
客戶服務諮詢電話：95521
網址：www.gtja.com
- (24) 廣發證券股份有限公司
註冊地址：廣東省廣州市黃埔區中新廣州知識城騰飛一街2號618室
辦公地址：廣州市天河區馬場路26號廣發證券大廈
法定代表人：孫樹明
統一客戶服務熱線：95575 或致電各地營業網點
公司網站：www.gf.com.cn
- (25) 招商證券股份有限公司
註冊地址：深圳市福田區福田路街道福華一路111號
法定代表人：霍達
客戶服務電話：95565
網址：www.newone.com.cn
- (26) 光大證券股份有限公司
註冊地址：上海市靜安區新閘路1508號
辦公地址：上海市靜安區新閘路1508號
法定代表人：周健男
客戶服務熱線：95525
網址：www.ebscn.com

- (27) 中國銀河證券股份有限公司
註冊地址：北京市西城區金融大街35號2-6層
法定代表人：陳共炎
客戶服務電話：4008888888
網址：www.chinastock.com.cn
- (28) 中信建投證券股份有限公司
註冊地址：北京市朝陽區安立路66號4號樓
辦公地址：北京市東城區朝內大街188號
法定代表人：王常青
客戶服務諮詢電話：400-8888-108
網址：www.csc108.com
- (29) 興業證券股份有限公司
註冊地址：福州市湖東路268號
法定代表人：楊華輝
客戶服務熱線：95562
公司網站：www.xyjq.com.cn
- (30) 海通證券股份有限公司
註冊地址：上海市廣東路689號
法定代表人：周杰
客戶服務電話：95553
公司網址：www.htsec.com
- (31) 國都證券股份有限公司
註冊地址：北京市東城區東直門南大街3號國華投資大廈9層10層
辦公地址：北京市東城區東直門南大街3號國華投資大廈9層10層
法定代表人：翁振杰
客戶服務電話：4008188118
網址：www.guodu.com
- (32) 國信證券股份有限公司
註冊地址：深圳市紅嶺中路1012號國信證券大廈16-26層
法定代表人：何如
客戶服務電話：95536
公司網址：www.guosen.com.cn
- (33) 華泰證券股份有限公司
註冊地址：江蘇省南京市建鄴區江東中路228號華泰證券廣場
法定代表人：周易
客戶諮詢電話：95597
網址：www.htsc.com.cn

- (34) 中信證券股份有限公司
註冊地址：廣東省深圳市福田區中心三路8號卓越時代廣場(二期)北座
辦公地址：北京市朝陽區亮馬橋路48號中信證券大廈
法定代表人：張佑君
客戶服務熱線：95548
公司網址：www.cs.ecitic.com
- (35) 東方證券股份有限公司
註冊地址：上海市中山南路318號2號樓22層-29層
法定代表人：潘鑫軍
客戶服務熱線：95503
東方證券網站：www.dfzq.com.cn
- (36) 中信證券(山東)有限責任公司
註冊和辦公地址：山東省青島市嶗山區深圳路222號1號樓2001
法定代表人：姜曉林
客戶服務電話：95548
公司網址：www.sd.citics.com
- (37) 華福證券有限責任公司
註冊地址：福州市五四路157號新天地大廈7、8層
辦公地址：福州市五四路157號新天地大廈7至10層
法定代表人：黃金琳
客戶服務熱線：0591-96326
公司網址：www.hfzq.com.cn
- (38) 中國國際金融股份有限公司
註冊地址：北京市建國門外大街1號國貿大廈2座27層及28層
辦公地址：北京市建國門外大街1號國貿大廈2座27層及28層
法定代表人：丁學東
電話：021-58881690
公司網址：www.cicc.com.cn
- (39) 安信證券股份有限公司
註冊地址：深圳市福田區金田路4018號安聯大廈35層、28層A02單元
辦公地址：深圳市福田區金田路4018號安聯大廈35層、28層A02單元
法定代表人：王連志
客服電話：95517
公司網址：www.essence.com.cn

- (40) 上海華信證券有限責任公司
註冊地址：上海市浦東新區世紀大道 100 號環球金融中心 9 樓
法定代表人：陳燦輝
客戶服務電話：400-820-5999
公司網站：www.shhxzq.com
- (41) 長江證券股份有限公司
註冊地址：武漢市新華路特 8 號長江證券大廈
法定代表人：李新華
客戶服務熱線：95579 或 4008-888-999
長江證券客戶服務網站：www.95579.com
- (42) 平安證券股份有限公司
註冊地址：深圳市福田區益田路 5033 號平安金融中心 61 層-64 層
辦公地址：深圳市福田區益田路 5033 號平安金融中心 61 層-64 層
法定代表人：何之江
客戶服務電話：95511-8
網址：www.stock.pingan.com
- (43) 東海證券股份有限公司
註冊地址：江蘇省常州市延陵西路 23 號投資廣場 18 層
法定代表人：趙俊
客戶服務電話：95531；4008888588
公司網站：www.longone.com.cn
- (44) 諾亞正行基金銷售有限公司
註冊地址：上海市虹口區飛虹路 360 弄 9 號 3724 室
辦公地址：上海市楊浦區長陽路 1687 號 2 號樓
法定代表人：汪靜波
客服電話：400-821-5399
公司網站：www.noah-fund.com
- (45) 上海長量基金銷售有限公司
註冊地址：上海市浦東新區高翔路 526 號 2 幢 220 室
辦公地址：上海市浦東新區東方路 1267 號陸家嘴金融服務廣場二期 11 層
法定代表人：張躍偉
客戶服務電話：400-820-2899
公司網站：www.erichfund.com

- (46) 北京展恆基金銷售股份有限公司
註冊地址：北京市順義區後沙峪鎮安富街6號
辦公地址：北京市朝陽區安苑路11號郵電新聞大廈6層
法定代表人：閻振杰
客戶服務電話：400-818-8000
公司網站：www.myfund.com
- (47) 上海華夏財富投資管理有限公司
住所：上海市虹口區東大名路687號1幢2樓268室
辦公地址：北京市西城區金融大街33號通泰大廈B座8層
法定代表人：毛淮平
客戶服務電話：400-817-5666
- (48) 上海萬得基金銷售有限公司
住所：中國(上海)自由貿易試驗區福山路33號11樓B座
辦公地址：上海市浦東新區浦明路1500號萬得大廈11樓
法定代表人：王廷富
客戶服務電話：400-799-1888
網址：www.520fund.com.cn
- (49) 上海基煜基金銷售有限公司
辦公地址：上海市浦東新區銀城中路488號太平金融大廈1503室
法定代表人：王翔
諮詢電話：400-820-5369
網站：www.jiyufund.com.cn
- (50) 嘉實財富管理有限公司
住所：上海市浦東新區世紀大道8號上海國金中心辦公樓二期53層5312-15單元
法定代表人：趙學軍
客服電話：400-021-8850
網站：www.harvestwm.cn
- (51) 星展銀行(中國)有限公司
住所：上海市浦東新區陸家嘴環路1318號1301、1801單元
法定代表人：葛甘牛
諮詢電話：400-820-8988
網站：www.dbs.com.cn

- (52) 花旗銀行(中國)有限公司
註冊地址：上海市浦東新區花園石橋路33號花旗集團大廈主樓28樓01A單元、02A單元和04單元，29樓02單元，30樓01單元，32樓01單元和01B單元，33樓01單元和03單元，34樓01單元及35樓
辦公地址：上海市浦東新區花園石橋路33號花旗集團大廈主樓28樓01A單元、02A單元和04單元，29樓02單元，30樓01單元，32樓01單元和01B單元，33樓01單元和03單元，34樓01單元及35樓
法定代表人：歐兆倫(AU SIU LUEN)
客戶服務熱線：個人客戶服務中心電話：800 8301 880
公司網站：www.citibank.com.cn
- (53) 東亞銀行(中國)有限公司
辦公地址：上海浦東新區花園石橋路66號東亞銀行金融大廈29樓
法定代表人：李國寶
客服電話：95382
網站：www.hkbea.com.cn
- (54) 渣打銀行(中國)有限公司
住所：上海市浦東新區世紀大道201號渣打銀行大廈13層1室，16層(實際樓層15層)、17層(實際樓層16層)、18層4室(實際樓層17層4室)、19層(實際樓層18層)、20層1室(實際樓層19層1室)、21層1、3、4室(實際樓層20層1、3、4室)、23層(實際樓層22層)、25層2、4室(實際樓層23層2、4室)、27層2室(實際樓層25層2室)、28層(實際樓層26層)
法定代表人：張曉蕾
客服電話：4008888083
網站：www.sc.com.cn
- (55) 滙豐銀行(中國)有限公司
註冊地址：上海市世紀大道8號國金中心滙豐銀行大樓22層
法人代表：廖宜建
客服電話：400-820-8828 / +86(0)21 38888828
網站：www.hsbc.com.cn
- (56) 恒生銀行(中國)有限公司
辦公地址：上海市浦東新區陸家嘴環路1000號恒生銀行大廈34樓、36樓及上海市浦東南路528號證券大廈27樓
法定代表人：鄭慧敏
客服電話：800-830-4888
網站：www.hangseng.com

- (57) 中信期貨有限公司
辦公地址：深圳市福田區中心三路8號卓越時代廣場(二期)北座13層
1301-1305室、14層
法定代表人：張皓
電話：400-990-8826
網站：www.citicsf.com
- (58) 上海好買基金銷售有限公司
註冊地址：上海市虹口區場中路685弄37號4號樓449室
辦公地址：上海市浦東南路1118號鄂爾多斯大廈903-906室
法定代表人：楊文斌
客服電話：400-700-9665
公司網站：www.ehowbuy.com
- (59) 深圳眾祿基金銷售股份有限公司
註冊地址：深圳市羅湖區深南東路5047號發展銀行大廈25樓I、J單元
辦公地址：深圳市羅湖區深南東路5047號發展銀行大廈25樓I、J單元
法定代表人：薛峰
客服電話：4006-788-887
公司網站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com
- (60) 螞蟻(杭州)基金銷售有限公司
註冊地址：浙江省杭州市余杭區五常街道文一西路969號3幢5層599室
辦公地址：杭州市西湖區萬塘路18號黃龍時代廣場B座6樓
法定代表人：祖國明
客服電話：400-0766-123
公司網站：www.fund123.cn
- (61) 上海天天基金銷售有限公司
註冊地址：上海市徐匯區龍田路190號2號樓2層
辦公地址：上海市徐匯區宛平南路88號東方財富大廈
法定代表人：其實
客服電話：400-1818-188
網站：www.1234567.com.cn
- (62) 浙江同花順基金銷售有限公司
註冊地址：浙江省杭州市文二西路一號元茂大廈903
辦公地址：浙江省杭州市翠柏路7號杭州電子商務產業園2樓
法定代表人：凌順平
客服電話：4008-773-772
公司網站：www.5ifund.com

- (63) 上海陸金所基金銷售有限公司
註冊地址：上海市浦東新區陸家嘴環路1333號14樓09單元
辦公地址：上海市浦東新區陸家嘴環路1333號14樓
法定代表人：胡學勤
客服電話：400-821-9031
網站：www.lufunds.com
- (64) 北京虹點基金銷售有限公司
註冊地址：北京市朝陽區工人體育場北路甲2號裙房2層222單元
辦公地址：北京市朝陽區工人體育場北路甲2號裙房2層222單元
法定代表人：鄭毓棟
客服電話：400-618-0707
網站：www.hongdianfund.com
- (65) 珠海盈米財富管理有限公司
註冊地址：珠海市橫琴新區寶華路6號105室-3491
辦公地址：廣州市海珠區琶洲大道東1號保利國際廣場南塔12樓
法定代表人：肖雯
客服電話：020-89629066
網站：www.yingmi.cn
- (66) 北京新浪倉石基金銷售有限公司
註冊地址：北京市海澱區東北旺西路中關村軟件園二期(西擴)N-1、N-2
地塊新浪總部科研樓5層518室
辦公地址：北京市海澱區東北旺西路中關村軟件園二期(西擴)N-1、N-2
地塊新浪總部科研樓5層518室
法定代表人：李昭琛
客戶服務電話：010-62675369
網站：www.xincai.com
- (67) 北京肯特瑞基金銷售有限公司
註冊地址：北京市海澱區海澱東三街2號4層401-15
辦公地址：北京市亦莊經濟開發區科創十一街18號院京東集團總部
法定代表人：江卉
客服電話：4000988511/4000888816
網址：<http://fund.jd.com/>

- (68) 中證金牛(北京)投資諮詢有限公司
註冊地址：北京市丰台区東管頭1號2號樓2-45室
辦公地址：北京市西城區宣武門外大街甲1號環球財訊中心A座5層
法定代表人：錢昊旻
客戶服務電話：4008-909-998
網址：www.jnlc.com
- (69) 奕豐基金銷售有限公司
註冊地址：深圳市前海深港合作區前灣一路1號A棟201室(入駐深圳市前海商務秘書有限公司)
辦公地址：深圳市南山區海德三道航天科技廣場A座17樓1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
客服電話：400-684-0500
網址：www.ifastps.com.cn

基金管理人可根據有關法律法規的要求，選擇其他符合要求的機構代理銷售本基金，並在基金管理人網站公示。

- 3、 H類基金單位的香港代表
名稱：摩根基金(亞洲)有限公司
註冊地址：香港中環干諾道中8號遮打大廈21樓
辦公地址：香港中環干諾道中8號遮打大廈21樓
聯絡電話：(852) 2978 7788
網站：<https://www.jpmorganam.com.hk/JFAsset/web/promotionsFile/mrf/cn/index.html>
- 4、 H類基金單位銷售機構：
截至2019年10月31日，摩根基金(亞洲)有限公司、中國銀行(香港)有限公司、交通銀行(香港)有限公司、中國建設銀行(亞洲)股份有限公司、恆生銀行有限公司、招商永隆銀行有限公司、中信銀行(國際)有限公司、中國工商銀行(亞洲)有限公司、新鴻基投資服務有限公司、上海商業銀行有限公司、東亞銀行有限公司、星展銀行(香港)有限公司、御峰理財有限公司、康宏資產管理有限公司、大新銀行有限公司、華僑永亨銀行有限公司、奕豐金融(香港)有限公司為上投摩根新興動力基金H類基金單位在香港地區的銷售機構。

- (二) 基金註冊登記機構：
上投摩根基金管理有限公司(同上)

(三) 律師事務所與經辦律師：

名稱：國浩律師集團(上海)事務所
註冊地址：上海市南京西路580號南證大廈31樓
負責人：管建軍
聯絡電話：021-5234 1668
傳真：021-5234 1670
經辦律師：宣偉華

(四) 審計基金資產的會計師事務所

名稱：普華永道中天會計師事務所(特殊普通合伙)
註冊地址：中國上海市浦東新區陸家嘴環路1318號星展銀行大廈6樓
辦公地址：中國上海市黃浦區湖濱路202號企業天地2號樓普華永道中心11樓
執業事務合夥人：李丹
聯絡電話：(021) 23238888
傳真：(021)23238800
聯絡人：沈兆杰
經辦註冊會計師：薛競、沈兆杰

六、基金的募集及基金合同的生效

本基金經中國證監會證監許可[2011]604號文批准，2011年6月15日起至2011年7月8日為募集期。本次募集的淨銷售額為459,128,666.54元人民幣，認購款項在基金驗資確認日之前產生的銀行利息共計45,632.38元人民幣。

本次募集有效認購總戶數為9922戶，按照每份基金單位1.00元人民幣計算，募集發售期募集的有效份數為459,128,666.54份基金單位，利息結轉的基金單位為45,632.38份基金單位，兩項合計共459,174,298.92份基金單位，已全部計入投資者基金賬戶，歸投資者所有。

經中國證券監督管理委員會核准，本基金的基金合同於2011年7月13日生效。本基金為契約型開放式股票型基金，存續期限為不定期。

根據《公開募集證券投資基金運作管理辦法》，自2015年7月21日起，本基金基金名稱中的基金類型變更為混合型證券投資基金。

七、基金單位的申購、贖回和轉換

(一) 申購和贖回場所

本基金的申購與贖回將通過基金管理人的直銷中心及代銷機構的代銷網點進行。具體的銷售網點將由基金管理人在招募說明書或其他公告中列明。基金管理人可根據情況變更或增減代銷機構，並在基金管理人網站公示。投資者可以在銷售機構辦理基金銷售業務的營業場所或按銷售機構提供的其他方式辦理基金的申購與贖回。

(二) 申購和贖回的開放日及時間

1、 開放日及開放時間

基金投資者在開放日申請辦理基金單位的申購和贖回，具體辦理時間為上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日的交易時間。但基金管理人根據法律法規、中國證監會的要求或本基金合同的規定公告暫停申購、贖回時除外。

基金合同生效後，若出現新的證券交易市場、證券交易所交易時間變更或其他特殊情況，基金管理人將視情況對前述開放日及開放時間進行相應的調整，但應在實施日前依照《信息披露辦法》的有關規定在指定媒體上公告。

2、 申購、贖回開始日及業務辦理時間

基金管理人自基金合同生效之日起不超過3個月開始辦理申購，具體業務辦理時間在申購開始公告中規定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超過3個月開始辦理贖回，具體業務辦理時間在贖回開始公告中規定。

在確定申購開始與贖回開始時間後，由基金管理人在開始日前依照《信息披露辦法》的有關規定在至少一種指定媒體和基金管理人的公司網站上公告。

基金管理人不得在基金合同約定之外的日期或者時間辦理基金單位的申購、贖回或者轉換。基金投資者在基金合同約定之外的日期和時間提出申購、贖回或轉換申請的，其基金單位申購、贖回價格為下次辦理基金單位申購、贖回時間所在開放日的價格。

(三) 申購與贖回的程序

1、 申購和贖回的申請

基金投資者必須根據銷售機構規定的程序，在開放日的具體業務辦理時間內提出申購或贖回的申請。

基金投資者在提交申購申請時須按銷售機構規定的方式備足申購資金，基金投資者在提交贖回申請時須持有足夠的基金單位餘額，否則所提交的申購、贖回申請無效而不予成交。

2、 申購和贖回申請的確認

T日規定時間受理的申請，正常情況下，註冊登記機構在T+1日內(包括該日)為投資者對該交易的有效性進行確認，基金投資者可在T+2日後(包括該日)到銷售網點櫃台或以銷售機構規定的其他方式查詢申請的確認情況。

銷售機構對申購申請的受理並不代表該申請一定成功，而僅代表銷售機構確實接收到申購申請。申購的確認以註冊登記機構的確認結果為準。

3、 申購和贖回的款項支付

申購採用全額繳款方式，若申購資金在規定時間內未全額到賬則申購不成功。若申購不成功或無效，基金管理人或基金管理人指定的代銷機構將基金投資者已繳付的申購款項本金退還給投資者。

基金投資者贖回申請成功後，基金管理人將通過註冊登記機構及其相關銷售機構在T+7日(包括該日)內支付贖回款項。在發生巨額贖回時，款項的支付辦法參照本基金合同有關條款處理。

(四) 申購和贖回的金額

- 1、 本基金A類份額申購的單筆最低金額為10元人民幣(含申購費)；H類份額申購的單筆最低金額為100元人民幣(含申購費)。基金投資者將當期分配的基金收益轉購基金單位時，不受最低申購金額的限制。

基金投資者可多次申購，法律法規、中國證監會另有規定的除外。

- 2、 基金投資者可將其全部或部分基金單位贖回。本基金按照單位進行贖回，申請贖回單位精確到小數點後兩位，每次贖回A類份額不得低於10份，基金賬戶餘額不得低於10份；每次贖回H類份額不得低於100份，基金賬戶餘額不得低於100份，如進行一次贖回後基金賬戶中基金份額餘額將低於最低份額，應一次性贖回。如因股息再投資、非交易過戶、轉託管、巨額贖回、基金轉換等原因導致的賬戶餘額少於最低份額之情況，不受此限，但再次贖回時必須一次性全部贖回。
- 3、 基金管理人可以規定單個投資人累計持有的基金單位上限，具體規定請參見更新的招募說明書。
- 4、 當接受申購申請對存量基金份額持有人利益構成潛在重大不利影響時，基金管理人應當採取設定單一投資者申購金額上限或基金單日淨申購比例上限、拒絕大額申購、暫停基金申購等措施，切實保護存量基金份額持有人的合法權益。具體規定請參見相關公告。
- 5、 基金管理人可以根據市場情況，在法律法規允許的情況下，調整上述規定申購金額和贖回單位的數量限制。基金管理人必須在調整前依照《信息披露辦法》的有關規定在中國證監會指定媒體上公告。

(五) 申購和贖回的價格、費用及其用途

1、 基金單位的股份類別

本基金根據基金銷售地及申購贖回費率的不同，將基金單位分為不同的股份類別。

僅在中國大陸地區銷售，並收取申購和贖回費用的基金單位，稱為A類基金單位；僅在中國香港地區銷售，並收取申購和贖回費用的基金單位，稱為H類基金單位。本基金A類和H類基金單位分設不同的基金代碼，並分別公佈基金單位淨值。

在不違反法律法規、基金合同的約定以及對基金單位持有人利益無實質性不利影響的情況下，根據基金實際運作情況，在履行適當程序後，基金管理人可停止某類股份類別的銷售、或者調整某類股份類別的費率水平、或者增加新的股份類別等，調整實施前基金管理人需及時公告，而無需召開基金單位持有人大會。

2、 基金申購單位的計算

$$\text{申購費用} = (\text{申購金額} \times \text{申購費率}) / (1 + \text{申購費率})$$

$$\text{淨申購金額} = \text{申購金額} - \text{申購費用}$$

$$\text{申購單位} = \text{淨申購金額} / \text{T日基金單位淨值}$$

各股份類別的基金單位的申購費率如下所示：

A類基金單位的申購費率如下表所示：

申購金額區間	費率
人民幣 100 萬以下	1.5%
人民幣 100 萬以上(含)，500 萬以下	1.0%
人民幣 500 萬以上(含)	每筆人民幣 1,000 元

H類基金單位的申購費率最高不超過申購金額的5%。

3、 基金贖回金額的計算

本基金的贖回金額為贖回總額扣減贖回費用。其中，

$$\text{贖回總額} = \text{贖回份數} \times \text{T日基金單位淨值}$$

$$\text{贖回費用} = \text{贖回總額} \times \text{贖回費率}$$

$$\text{贖回金額} = \text{贖回總額} - \text{贖回費用}$$

A類基金單位贖回費率如下表所示：

持有基金單位期限	費率
小於七日	1.5%
大於等於七日，小於一年	0.5%
大於等於一年小於兩年	0.35%
大於等於兩年小於三年	0.2%
大於等於三年	0%

H類基金單位的贖回費率最高不超過基金單位贖回金額的0.5%。

- 4、 本基金A類基金單位和H類基金單位分別設置代碼，並分別計算基金單位淨值。T日的基金單位淨值在當天收市後計算，並按基金合同的約定公告。遇特殊情況，經中國證監會同意，可以適當延遲計算或公告。
- 5、 申購單位餘額的處理方式：申購的有效單位為淨申購金額除以當日的基金單位淨值，有效單位為份。上述計算結果均按四捨五入方法，保留到小數點後兩位，由此誤差產生的收益或損失由基金資產承擔。
- 6、 贖回金額的處理方式：贖回金額為按實際確認的有效贖回單位乘以當日基金單位淨值並扣除相應的費用，贖回金額單位為元。上述計算結果均按四捨五入方法，保留到小數點後兩位，由此誤差產生的收益或損失由基金資產承擔。
- 7、 本基金兩類單位淨值的計算，均保留到小數點後3位，小數點後第4位四捨五入，由此產生的誤差在基金資產中列支。
- 8、 本基金的申購費用由投資人承擔，並應在投資人申購基金單位時收取，不列入基金資產，主要用於本基金的市場推廣、銷售、註冊登記等各項費用。
- 9、 贖回費用由贖回基金單位的基金單位持有人承擔，在基金單位持有人贖回基金單位時收取。本基金將對持續持有期少於7日的A類基金份額的投資者收取不低於1.5%的贖回費，並將上述贖回費全額計入基金財產；除此之外，A類基金份額不低於贖回費總額的25%應歸基金資產，其餘用於支付註冊登記費和其他必要的手續費。H類基金份額的贖回費全部歸基金財產。
- 10、 本基金的申購費率最高不超過申購金額的5%，贖回費率最高不超過贖回金額的5%。基金管理人可以在基金合同約定的範圍內調整費率或收費方式，並最遲應於新的費率或收費方式實施日3個工作日前依照《信息披露辦法》的有關規定在中國證監會指定媒體上公告。

- 11、 基金管理人可以在不違反法律法規規定及基金合同約定的情形下根據市場情況制定基金促銷計劃，針對以特定交易方式（如網上交易、電話交易等）等進行基金交易的投資人定期或不定期地開展基金促銷活動。在基金促銷活動期間，按相關監管部門要求履行必要手續後，基金管理人可以適當調低基金申購費率和基金贖回費率。

（六） 拒絕或暫停申購的情形

發生下列情況時，基金管理人可拒絕或暫停接受基金投資者的申購申請：

- 1、 因不可抗力導致基金無法正常運作；
- 2、 證券交易所交易時間非正常停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值；
- 3、 發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況；
- 4、 基金管理人認為會有損於現有基金單位持有人利益的某筆或數筆申購；
- 5、 基金資產規模過大，使基金管理人無法找到合適的投資品種，或基金管理人認為會損害已有基金單位持有人利益的申購；
- 6、 基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過50%，或者變相規避50%集中度的情形時；
- 7、 當前一估值日基金資產淨值50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受基金申購申請；
- 8、 法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

發生上述第1、2、3、5、7、8項暫停申購情形時，基金管理人應當根據有關規定在指定媒體和基金管理人網站上刊登暫停申購公告。如果基金投資者的申購申請被拒絕，被拒絕的申購款項將退還給投資者。在暫停申購的情況消除時，基金管理人應及時恢復申購業務的辦理。

(七) 暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形

發生下列情形時，基金管理人可暫停接受基金投資者的贖回申請或延緩支付贖回款項：

- 1、因不可抗力導致基金管理人不能支付贖回款項。
- 2、證券交易所交易時間依法決定臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值。
- 3、連續兩個或兩個以上開放日發生巨額贖回。
- 4、發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況。
- 5、當前一估值日基金資產淨值50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當延緩支付贖回款項或暫停接受基金贖回申請。
- 6、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

發生上述情形時，基金管理人應在當日向中國證監會報告，已接受的贖回申請，基金管理人應按時足額支付；如暫時不能足額支付，可支付部分按單個賬戶申請量佔申請總量的比例分配給贖回申請人，未支付部分可延期支付，並以後續開放日的基金單位淨值為依據計算贖回金額，若出現上述第3項所述情形，按基金合同的相關條款處理。投資者在申請贖回時可事先選擇將當日可能未獲受理部分予以撤銷。暫停基金的贖回，基金管理人應及時在至少一家指定媒體及基金管理人網站上刊登暫停贖回公告。在暫停贖回的情況消除時，基金管理人應及時恢復贖回業務的辦理並公告。

(八) 巨額贖回的情形及處理方式

1、巨額贖回的認定

若本基金單個開放日內的基金單位淨贖回申請（贖回申請單位總數加上基金轉換中轉出申請單位總數後扣除申請申請單位總數及基金轉換中轉入申請單位總數後的餘額）超過前一日的基金單位總數的10%，即認為是發生了巨額贖回。

2、 巨額贖回的處理方式

當基金出現巨額贖回時，基金管理人可以根據基金當時的資產組合狀況決定全額贖回或部分順延贖回。

- (1) 全額贖回：當基金管理人認為有能力支付基金投資者的贖回申請時，按正常贖回程序執行。
- (2) 部分順延贖回：當基金管理人認為支付基金投資者的贖回申請有困難或認為支付投資者的贖回申請而進行的資產變現可能會對基金資產淨值造成較大波動時，基金管理人在當日接受贖回比例不低於上一日基金單位總數的10%的前提下，對其餘贖回申請延期辦理。對於當日的贖回申請，應當按單個賬戶贖回申請量佔贖回申請總量的比例，確定當日受理的贖回單位；基金投資者未能贖回部分，投資者在提交贖回申請時可以選擇延期贖回或取消贖回。選擇延期贖回的，將自動轉入下一個開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；選擇取消贖回的，當日未獲贖回的部分申請將被撤銷。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以該開放日的基金單位淨值為基礎計算贖回金額。如基金投資者在提交贖回申請時未作明確選擇，投資者未能贖回部分作自動延期贖回處理。
- (3) 若本基金發生巨額贖回且單個基金份額持有人的贖回申請超過上一開放日基金總份額的20%，基金管理人有權先行對該單個基金份額持有人超出20%以上的部分贖回申請實施延期辦理而對該單個基金份額持有人20%以內(含20%)的贖回申請與當日其他投資者的贖回申請按前述條款處理，具體見相關公告。

3、 巨額贖回的公告

當發生巨額贖回並順延贖回時，基金管理人應在2日內通過中國證監會指定媒體、基金管理人的公司網站或代銷機構的網點刊登公告，並在公開披露日向中國證監會和基金管理人主要辦公場所所在地中國證監會派出機構備案，並通過郵寄、傳真或者招募說明書規定的其他方式在3個工作日內通知基金單位持有人，並說明有關處理方法。

連續2日以上(含本數)發生巨額贖回，如基金管理人認為有必要，可暫停接受基金的贖回申請；已經接受的贖回申請可以延緩支付贖回款項，但不得超過20個工作日，並應當在指定媒體和基金管理人網站上進行公告。

(九) 暫停申購或贖回的公告和重新開放申購或贖回的公告

- 1、 發生上述暫停申購或贖回情況的，基金管理人應在規定期限內在指定媒介上刊登暫停公告。
- 2、 如發生暫停的時間為1日，第2個工作日基金管理人應依照有關規定在指定媒體和基金管理人網站上刊登基金重新開放申購或贖回公告，並公佈最近1個工作日的基金單位淨值。
- 3、 如發生暫停的時間超過1日但少於2周，暫停結束，基金重新開放申購或贖回時，基金管理人應依照《信息披露管理辦法》的有關規定，在指定媒體和基金管理人網站上刊登基金重新開放申購或贖回公告，並公告最近1個工作日的基金單位淨值。
- 4、 如發生暫停的時間超過2周，暫停期間，基金管理人應每2周至少刊登暫停公告1次。暫停結束，基金重新開放申購或贖回時，基金管理人應依照《信息披露管理辦法》的有關規定，在指定媒體和基金管理人網站上刊登基金重新開放申購或贖回公告，並公告最近1個工作日的基金單位淨值。

(十) 基金轉換

基金管理人可以根據相關法律法規以及本基金合同的規定決定開辦本基金與基金管理人管理的其他基金之間的轉換業務，基金轉換可以收取一定的轉換費，相關規則由基金管理人屆時根據相關法律法規及本基金合同的規定制定並公告，並及時告知基金託管人與相關機構。

(十一) 基金的非交易過戶

指基金註冊登記機構受理繼承、捐贈、司法強制執行和經註冊登記機構認可的其他情況而產生的非交易過戶。無論在上述何種情況下，接受劃轉的主體必須是依法可以持有本基金基金單位投資者。

繼承是指基金單位持有人死亡，其持有的基金單位由其合法的繼承人繼承；捐贈指基金單位持有人將其合法持有的基金單位捐贈給福利性質的基金會或社會團體；司法強制執行是指司法機構依據生效司法文書將基金單位持有人持有的基金單位強制劃轉給其他自然人、法人或其他組織。辦理非交易過戶必須提供基金註冊登記機構要求的相關資料，對於符合條件的非交易過戶申請自申請受理日起2個月內辦理，並按基金註冊登記機構規定的標準收費。

(十二) 基金的轉託管

基金單位持有人可辦理已持有基金單位在不同銷售機構之間的轉託管，基金銷售機構可以按照規定的標準收取轉託管費。

如果出現基金管理人、註冊登記機構、辦理轉託管的銷售機構因技術系統性能限制或其他合理原因，可以暫停該業務或者拒絕基金單位持有人的轉託管申請。

(十三) 定期定額投資計劃

在各項條件成熟的情況下，本基金可為基金投資者提供定期定額投資計劃服務，具體實施方法以更新後的招募說明書和基金管理人屆時的公告為準。

(十四) 其他情形

基金賬戶和基金單位凍結、解凍的業務，由註冊登記機構辦理。

基金註冊登記機構只受理國家有關機關依法要求的基金賬戶或基金單位的凍結與解凍以及註冊登記機構認可的其他情況的基金賬戶或基金單位的凍結與解凍。基金賬戶或基金單位被凍結的，被凍結基金單位所產生的權益一併凍結，法律法規、中國證監會或法院判決、裁定另有規定的除外。

當基金單位處於凍結狀態時，基金註冊登記機構或其他相關機構應拒絕該部分基金單位的贖回申請、轉出申請、非交易過戶以及基金的轉託管。

八、基金的投資

(一) 投資目標

本基金在把握經濟結構調整和產業升級的發展趨勢基礎上，充分挖掘新興產業發展中的投資機會，重點關注新興產業中的優質上市公司，並兼顧傳統產業中具備新成長動力的上市公司進行投資，在有效控制風險的前提下，追求基金資產的穩定增值。

(二) 投資理念

在國家經濟轉型的大背景下，通過對經濟結構調整和產業升級方向的前瞻性分析，把握新興產業崛起過程中的投資機會，同時挖掘傳統產業升級和傳統產業公司自身發展變革帶來的投資新機遇，力爭實現基金資產的長期穩健增值。

(三) 投資範圍

本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支持證券以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。

基金的投資組合比例為：股票等股本類資產佔基金資產的60%-95%，債券等固定收益類資產佔基金資產的0-40%，權證投資佔基金資產淨值的0-3%，現金或到期日在一年期以內的政府債券不低於基金資產淨值的5%，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。本基金將不低於80%的股票資產投資於新興產業中的優質上市公司和傳統產業中具備新成長動力的上市公司股票。

如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其他品種，基金管理人在履行適當程序後，可以將其納入投資範圍。

(四) 投資策略

1、 資產配置策略

本基金對大類資產的配置是從宏觀層面出發，採用定量分析和定性分析相結合的手段，綜合宏觀經濟環境、宏觀經濟政策、產業政策、行業前景、證券市場走勢和流動性的綜合分析，積極進行大類資產配置。

影響資產收益的關鍵驅動因素主要包括基本面和流動性。基本面驅動，主要指在經濟周期和通脹周期影響下，業績增長、利率環境、通脹預期等因素的變動；流動性驅動主要體現為貨幣市場環境變動的影響，具體包括匯率變動、流動性結構變動等。隨着各類資產風險收益特徵的相對變化，本基金適時動態地調整股票、債券和貨幣市場工具的投資比例。

2、 股票投資策略

本基金管理人認為，從經濟發展的中長期趨勢看，轉變經濟發展方式實現經濟轉型已經成為我國在相當長一段時期內經濟發展的首要任務。在後金融危機時期，我國經濟面臨外需放緩、內部經濟結構矛盾突出等問題，要實現經濟持續健康的發展必須加快經濟結構和產業結構的調整。

縱觀世界各國和地區的經濟發展歷程，新興產業的崛起和傳統產業的升級換代是經濟轉型的主要驅動力。可以預見的是，新興產業內生的市場潛力在政府大力扶持的激發下，將帶動相關行業上下游全面發展，其間蘊藏着巨大的投資機會。而部分傳統產業也將通過新技術、新的商業模式或生產方式等實現產業升級，獲取新的成長驅動力。本基金一方面將從新興產業出發，深入挖掘新興產業發展過程中帶來的投資機會，另一方面將關注傳統產業中成長公司的投資。

(1) 挖掘新興產業中的優質上市公司

參考國家對策略性新興產業的選擇標準，本基金對新興產業的範圍進行了界定，具體包括：節能環保、新一代信息技術、生物、高端裝備製造、新能源、新材料和新能源汽車。由於新興產業是一個與時俱進動態更新的概念，隨着經濟與技術的不斷發展，新興產業的範圍也在不斷變化。我們將對各個產業進行動態跟蹤，定期或不定期對新興產業的範圍進行更新。

由於新興產業涵蓋多個子行業，本基金管理人將從多角度分析各行業的投資機會，主要從以下幾個方面綜合評估各行業的投資價值：1、政策影響分析。深入研究國家經濟政策、產業政策和區域政策，評估其對不同行業的影響方式和影響力度。2、市場廣度分析。主要分析各行業的產品需求的成長空間和增長速度。深入考察各個行業的發展現狀，參考政府和主要研究結構對各個行業市場容量的預測，評估其未來的成長空間及增長速度，從而判斷其未來的成長性機會。3、行業前景分析。分析經濟周期的不同階段對各行業的影響，利用反映各行業發展狀況的主要指標，並綜合考慮行業技術發展趨勢、組織創新和消費者需求變化等因素，判斷各個行業的前景。4、行業競爭結構分析。主要分析行業的技術研發能力和行業進入壁壘，判斷各個行業是否具有較強技術研發能力和較高的行業進入壁壘。

在股票選擇方面，本基金將從公司行業地位、核心競爭力、受國家政策的影響程度、盈利增長前景、公司治理結構等多方面評估上市公司的投資價值，精選新興產業上市公司中具有核心技術和競爭優勢、從國家產業政策中受益較大，具有較大成長潛力的公司股票。

(2) 精選傳統產業中具備新成長動力的公司

對於傳統產業公司的投資，本基金將以影響公司持續成長能力的外部因素和內部因素為兩條主線，分別從宏觀層面和微觀層面出發，深入分析宏觀經濟環境以及公司內部因素的變化，評估其對上市公司的經營產生的影響，發掘公司持續發展的成長動力。通過系統的宏觀經濟分析、政策分析、基本面分析和市場分析，主要投資於傳統產業中受益於產業升級和公司自身發展變革而獲得新成長動力的上市公司股票。

在宏觀層面，本基金管理人將運用自上而下的分析方法，通過對宏觀經濟政策、產業政策、區域政策等因素的分析，選擇獲得國家政策支持、具有增長潛力的行業和個股進行配置。

在微觀層面，本基金將採用自下而上的方法精選個股，積極發現公司經營與發展過程中的重大要素變化，分析其對公司未來成長能力和盈利能力的影響。企業的成长模式可以分為內生性成長和外延式成長兩類。企業的內生性成長是指企業利用自身內部資源實現的成長，外延式成長是企業採用併購等資本運作手段，利用外部資源實現的成長。本基金管理人將採用自下而上的研究方法，深入挖掘公司未來成長的新驅動因素，並從公司發展策略、核心競爭力、盈利能力與盈利質量、財務健康狀況、公司治理結構等方面對上市公司的投資價值進行評估，尋找具有良好成長潛力的上市公司股票。

在以上分析的基礎上，本基金將重點關注以下兩類傳統產業上市公司：
(1) 產業升級過程中獲得國家政策扶持、具有核心技術優勢的傳統產業中具有確定性成長機會的上市公司。(2) 公司資產通過收購、置換發生重大變化，或者公司技術或產品取得突破，從而獲得新成長動力的上市公司。

(3) 估值優化

為了避免投資於估值過高的公司股票，本基金將結合上市公司所處行業、業務模式等特徵，採用市盈率法(P/E)、市淨率法(P/B)、市盈率－長期成長法(PEG)、企業價值／息稅折舊攤銷前利潤法(EV/EBITDA)等相對估值指標與股息折現模型(DDM)、自由現金流折現模型(FCFF, FCFE)等絕對估值方法，進一步精選出估值合理的股票構建投資組合。

3、 固定收益類投資策略

對於固定收益類資產的選擇，本基金將以價值分析為主線，在綜合研究的基礎上實施積極主動的組合管理，並主要通過類屬配置與債券選擇兩個層次進行投資管理。

在類屬配置層次，結合對宏觀經濟、市場利率、債券供求等因素的綜合分析，根據交易所市場與銀行間市場類屬資產的風險收益特徵，定期對投資組合類屬資產進行優化配置和調整，確定類屬資產的最優權重。

在券種選擇上，本基金以中長期利率趨勢分析為基礎，結合經濟趨勢、貨幣政策及不同債券品種的收益率水平、流動性和信用風險等因素，重點選擇那些流動性較好、風險水平合理、到期收益率與信用質量相對較高的債券品種。具體策略有：

- (1) 利率預期策略：本基金首先根據對國內外經濟形勢的預測，分析市場投資環境的變化趨勢，重點關注利率趨勢變化。通過全面分析宏觀經濟、貨幣政策與財政政策、物價水平變化趨勢等因素，對利率走勢形成合理預期。
- (2) 估值策略：建立不同品種的收益率曲線預測模型，並利用這些模型進行估值，確定價格中樞的變動趨勢。根據收益率、流動性、風險匹配原則以及債券的估值原則構建投資組合，合理選擇不同市場中有投資價值的券種。
- (3) 年期管理：本基金努力把握年期與債券價格波動之間的量化關係，根據未來利率變化預期，以年期和收益率變化評估為核心，通過年期管理，合理配置投資品種。
- (4) 流動性管理：本基金通過緊密關注申購／贖回現金流情況、季節性資金流動、日曆效應等，建立組合流動性預警指標，實現對基金資產的結構化管理，以確保基金資產的整體變現能力。

4、可轉換債券投資策略

可轉換債券(含交易分離可轉債)兼具股本類證券與固定收益類證券的特性，具有抵禦下行風險、分享股票價格上漲收益的特點。可轉債的選擇結合其債性和股性特徵，在對公司基本面和轉債條款深入研究的基礎上進行估值分析，投資於公司基本面優良、具有較高安全邊際和良好流動性的可轉換債券，獲取穩健的投資回報。

5、權證投資策略

權證為本基金輔助性投資工具，投資原則為有利於基金資產增值，有利於加強基金風險控制。本基金在投資權證時，將通過對權證相關證券基本面的深入研究，結合權證定價模型及其隱含波動率等指標，尋求其合理的估值水平，謹慎投資，以追求較穩定的當期收益。

(五) 業績比較基準

中國戰略新興產業成份指數收益率 *85%+ 上證國債指數收益率 *15%

中國戰略新興產業成份指數由中證指數有限公司編製，選取節能環保、新一代信息技術產業、生物產業、高端裝備製造、新能源產業、新材料產業、新能源汽車、數碼創意產業、高技術服務業等領域具有代表性的 100 家上市公司，採用自由流通股本加權方式，反映中國戰略新興產業上市公司的走勢。上證國債指數是樣本券由在上海證券交易所上市的固定利率國債構成，採用國債發行量加權計算的債券指數。根據本基金的投資範圍和投資比例，選用上列業績比較基準能夠客觀、合理地反映本基金的風險收益特徵。

如果上述基準指數停止計算編製或更改名稱，或者今後法律法規發生變化，或者是市場中出現更具有代表性的業績比較基準，或者更科學的複合指數權重比例，本基金將根據實際情況在與基金託管人協商一致的情況下對業績比較基準予以調整。業績比較基準的變更應按照法律法規及監管部門要求履行適當的程序，報中國證監會備案，並予以公告，但無需召開基金單位持有人大會審議。

(六) 風險收益特徵

本基金屬混合型基金產品，預期風險和收益水平低於股票型基金，高於債券型基金和貨幣市場基金，屬風險水平較高的基金產品。

本基金風險收益特徵會定期評估並在公司網站發佈，請投資者關注。

(七) 投資決策依據

- 1、 國家有關法律、法規和《基金合同》的規定；
- 2、 宏觀經濟形勢和證券市場走勢；
- 3、 國家財政政策、貨幣政策、產業政策、區域規劃與發展政策；
- 4、 產業發展趨勢和上市公司基本面。

(八) 投資決策流程

投資決策基本原則是依據本基金合同所制定投資基本方針、投資範圍及投資限制等，擬訂基金投資策略及執行投資計劃。適度控制風險及資產安全，並追求投資利得的合理增長，最大限度地保障基金持有人的利益。

公司投資決策採用投資決策委員會集體決策與基金經理授權決策相結合的分級模式。由投資決策委員會決定資產配置、投資原則等宏觀決策；由基金經理負責組合構建、品種選擇、時機選擇等具體決策。本基金的具體投資決策流程如下：

- 1、 基金的投資是建立在深入的研究分析基礎上的，本基金將依託公司強大的內部研究平台，並整合外部券商的研究成果，由研究員在實地調研和案頭分析的基礎上提供研究報告供投資決策委員會和基金經理參考。
- 2、 投資決策委員會是基金投資管理的核心決策機構。投資決策委員會將定期或不定期召開會議，在依照有關法律法規與基金合同所確定的投資限制綱領的範圍內，分析評價投資操作績效，並在對現有資產配置進行總結的基礎上，作出資產配置決議，確定證券評級模式，作為基金經理進行投資操作的依據。
- 3、 基金經理根據投資決策委員會的決策，在其授權範圍內構建投資組合並負責組織實施、追蹤和調整，以實現基金的投資目標。
- 4、 交易部執行基金經理的交易指令，並對交易情況及時作出反饋。
- 5、 風險管理部定期和不定期對基金進行風險和績效評估，並提供相關報告。

(九) 投資限制

本基金的投資組合將遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超過基金資產淨值的10%；
- (2) 本基金與由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司發行的證券，不超過該證券的10%；

- (3) 本基金管理人管理的全部開放式基金持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該公司可流通股票的15%；
- (4) 本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該公司可流通股票的30%；
- (5) 進入全國銀行間同業市場的債券回購融入的資金餘額不得超過基金資產淨值的40%。債券回購最長期限為1年，債券回購到期後不得展期；
- (6) 本基金參與股票發行申購，本基金所申報的金額不超過本基金的總資產，本基金所申報的股票數量不超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；
- (7) 保持不低於基金資產淨值5%的現金或者到期日在一年以內的政府債券，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等；
- (8) 本基金投資權證，在任何交易日買入的總金額，不超過上一交易日基金資產淨值的0.5%，基金持有的全部權證的市值不超過基金資產淨值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一權證的比例不超過該權證的10%。投資於其他權證的投資比例，遵從法律法規或監管部門的相關規定；
- (9) 本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的10%；本基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券的比例，不得超過該基金資產淨值的10%；基金管理人管理的全部證券投資基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的10%；本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過該基金資產淨值的20%；
- (10) 本基金投資於流動性受限資產的市值合計不得超過該基金資產淨值的15%。
因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；
- (11) 本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同約定的投資範圍保持一致；

- (12) 本基金不得違反基金合同中有關投資範圍、投資策略、投資比例的規定；
- (13) 法律法規或監管部門對上述比例限制另有規定的，從其規定。

基金管理人應當自基金合同生效之日起六個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。在符合相關法律法規規定的前提下，因證券市場波動、上市公司合併、基金規模變動等非本基金管理人的因素致使基金的投資組合不符合上述規定的投資比例的，除上述第(7)、(10)、(11)項外，基金管理人應當在10個交易日內進行調整。法律法規或監管部門另有規定的，從其規定。

若法律法規或監管部門取消上述限制，履行適當程序後，本基金投資可不受上述規定限制。

(十) 禁止行為

為維護基金單位持有人的合法權益，本基金禁止從事下列行為：

- 1、 承銷證券；
- 2、 向他人貸款或者提供擔保；
- 3、 從事承擔無限責任的投資；
- 4、 買賣其他基金單位，但是國務院另有規定的除外；
- 5、 向基金管理人、基金託管人出資或者買賣基金管理人、基金託管人發行的股票或者債券；
- 6、 買賣與基金管理人、基金託管人有控股關係的股東或者與基金管理人、基金託管人有其他重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券；
- 7、 從事內幕交易、操縱證券交易價格及其他不正當的證券交易活動；
- 8、 依照法律法規有關規定，由中國證監會規定禁止的其他活動。

若法律法規或監管部門取消上述禁止性規定，履行適當程序後，本基金投資可不受上述規定限制。

(十一) 基金管理人代表基金行使股東權利的處理原則及方法

- 1、 基金管理人按照國家有關規定代表基金獨立行使股東權利，保護基金單位持有人的利益；
- 2、 不謀求對上市公司的控股，不參與所投資上市公司的經營管理；
- 3、 有利於基金資產的安全與增值；
- 4、 不通過關聯交易為自身、僱員、授權代理人或任何存在利害關係的第三人牟取任何不當利益。

(十二) 基金的融資、融券

本基金可以根據有關法律法規和政策的規定進行融資、融券。

(十三) 基金的投資組合報告

- 1、 報告期末基金資產組合情況

序號	項目	金額(元)	佔基金總資產的比例(%)
1	股本投資	2,430,664,210.23	89.23
	其中：股票	2,430,664,210.23	89.23
2	固定收益投資	—	—
	其中：債券	—	—
	資產支持證券	—	—
3	貴金屬投資	—	—
4	金融衍生品投資	—	—
5	買入再售金融資產	—	—
	其中：買斷式回購的買入再售金融資產	—	—
6	銀行存款和結算備付金合計	268,878,715.30	9.87
7	其他各項資產	24,461,197.75	0.90
8	合計	2,724,004,123.28	100.00

2、 報告期末按行業分類的股票投資組合

代碼	行業類別	公允價值(元)	佔基金資產淨值比例(%)
A	農、林、牧、漁業	109,577,304.00	4.08
B	採礦業	—	—
C	製造業	2,141,660,031.36	79.67
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	—	—
E	建築業	—	—
F	批發和零售業	1,141,742.49	0.04
G	交通運輸、倉儲和郵政業	—	—
H	住宿和餐飲業	—	—
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	171,813,870.74	6.39
J	金融業	3,494,567.68	0.13
K	房地產業	—	—
L	租賃和商務服務業	—	—
M	科學研究和技術服務業	—	—
N	水利、環境和公共設施管理業	2,976,693.96	0.11
O	居民服務、修理和其他服務業	—	—
P	教育	—	—
Q	衛生和社會工作	—	—
R	文化、體育和娛樂業	—	—
S	綜合	—	—
	合計	2,430,664,210.23	90.42

3、 報告期末按市值佔基金資產淨值比例大小排序的前十名股票分析

序號	股票代碼	股票名稱	數量(股)	公允價值(元)	佔基金資產淨值比例(%)
1	002236	大華股份	13,743,786	237,355,184.22	8.83
2	601012	隆基股份	8,873,101	232,741,439.23	8.66
3	600438	通威股份	14,723,832	187,581,619.68	6.98
4	300014	億緯鋰能	5,083,824	154,497,411.36	5.75
5	002157	正邦科技	9,379,999	141,731,784.89	5.27
6	603501	韋爾股份	1,410,482	138,382,389.02	5.15
7	000661	長春高新	287,538	113,393,485.68	4.22
8	300601	康泰生物	1,497,119	111,146,114.56	4.13
9	002714	牧原股份	1,554,288	109,577,304.00	4.08
10	002241	歌爾股份	5,178,225	91,033,195.50	3.39

4、 報告期末按券種分類的債券投資組合

本基金本報告期末未持有債券。

5、 報告期末按市值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券分析

本基金本報告期末未持有債券。

6、 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排名的前十名資產支持證券投資分析：

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

- 7、 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資分析
本基金本報告期末未持有貴金屬。
- 8、 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排名的前五名權證投資分析：
本基金本報告期末未持有權證。
- 9、 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明
本基金本報告期末未持有股指期貨。
- 10、 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明
本基金本報告期末未持有國債期貨。
- 11、 投資組合報告附註
 - (1) 報告期內本基金投資的前十名證券的發行機構本期沒有出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。
 - (2) 報告期內本基金投資的前十名股票中沒有在基金合同規定備選股票庫之外的股票。
 - (3) 其他各項資產構成

序號	名稱	金額(元)
1	存出保證金	1,282,467.34
2	應收證券結算款	14,607,984.33
3	應收股息	-
4	應收利息	89,995.56
5	應收申購款	8,480,750.52
6	其他應收款	-
7	攤銷費用	-
8	其他	-
9	合計	24,461,197.75

- (4) 報告期末持有的處於轉股期的可轉換債券分析
本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

- (5) 報告期末前十名股票中存在流通受限情況的說明：
 本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。
- (6) 投資組合報告附註的其他文字描述部分
 因四捨五入原因，投資組合報告中分項之和與合計可能存在誤差。

九、基金的業績

基金管理人依照恪盡職守、誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利，也不保證最低收益。基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書。

上投摩根新興動力混合 A

階段	淨值增長率 ①	淨值增長率標準差 ②	業績比較基準收益率 ③	業績比較基準收益率標準差 ④	①-③	②-④
基金成立日－2011/12/31	-12.00%	0.75%	-18.19%	1.10%	6.19%	-0.35%
2012/01/01－2012/12/31	27.73%	1.23%	6.71%	1.02%	21.02%	0.21%
2013/01/01－2013/12/31	47.15%	1.63%	-5.57%	1.11%	52.72%	0.52%
2014/01/01－2014/12/31	-5.50%	1.35%	42.21%	0.97%	-47.71%	0.38%
2015/01/01－2015/12/31	65.39%	2.94%	5.68%	1.99%	59.71%	0.95%
2016/01/01－2016/12/31	-19.81%	2.10%	-8.35%	1.12%	-11.46%	0.98%
2017/01/01－2017/12/31	42.21%	1.37%	17.55%	0.51%	24.66%	0.86%
2018/01/01－2018/12/31	-35.65%	1.91%	-19.12%	1.07%	-16.53%	0.84%
2019/01/01－2019/6/30	31.15%	1.92%	22.06%	1.24%	9.09%	0.68%
2019/01/01－2019/9/30	44.65%	1.73%	22.03%	1.10%	22.62%	0.63%

上投摩根新興動力混合H

階段	淨值增長率①	淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
基金成立日－ 2016/12/31	1.57%	1.81%	5.22%	0.93%	-3.65%	0.88%
2017/01/01－ 2017/12/31	42.48%	1.37%	17.55%	0.51%	24.93%	0.86%
2018/01/01－ 2018/12/31	-35.67%	1.91%	-19.12%	1.07%	-16.55%	0.84%
2019/01/01－ 2019/6/30	31.14%	1.93%	22.06%	1.24%	9.08%	0.69%
2019/01/01－ 2019/9/30	44.71%	1.73%	22.03%	1.10%	22.68%	0.63%

十、基金的資產

(一) 基金資產總值

基金資產總值是指基金擁有的各類有價證券、銀行存款本息、基金應收款項以及其他資產的價值總和。

(二) 基金資產淨值

基金資產淨值是指基金資產總值減去基金負債後的金額。

(三) 基金資產的賬戶

本基金資產以基金名義開立銀行存款賬戶，以基金託管人的名義開立證券交易結算資金的結算備付金賬戶，以基金託管人和本基金聯名的方式開立基金證券賬戶，以本基金的名義開立銀行間債券託管賬戶。開立的基金專用賬戶與基金管理人、基金託管人、基金銷售機構和註冊登記機構自有的財產賬戶以及其他基金資產賬戶相獨立。

(四) 基金資產的處分

基金資產獨立於基金管理人、基金託管人和代銷機構的固有財產，並由基金託管人保管。基金管理人、基金託管人因基金資產的管理、運用或者其他情形而取得的財產和收益歸入基金資產。基金管理人、基金託管人可以按基金合同的約定收取管理費、託管費以及其他基金合同約定的其他費用。基金管理人、基金託管人以其自有財產承擔法律責任，其債權人不得對基金資產行使請求凍結、扣押和其他權利。

基金管理人、基金託管人因依法解散、被依法撤銷或者被依法宣告破產等原因進行清算的，基金資產不屬其清算財產。

基金資產的債權，不得與基金管理人、基金託管人固有財產的債務相抵銷；不同基金資產的債權債務，不得相互抵銷。

除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定處分外，基金資產不得被處分。非因基金資產本身承擔的債務，不得對基金資產強制執行。

十一、基金資產的估值

(一) 估值目的

基金資產的估值目的是客觀、準確地反映基金相關金融資產的公允價值，並為基金單位提供計價依據。

(二) 估值日

本基金的估值日為相關的證券交易場所的正常交易日，以及國家法律法規規定需要對外披露基金淨值的非交易日。

(三) 估值對象

基金依法擁有的股票、債券、權證及其他基金資產和負債。

(四) 估值方法

1、 股票估值方法：

(1) 上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在證券交易所的收市價估值；估值日無交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，以最近交易日的收市價估值；如果估值日無交易，且最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，將參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易日收市價，確定公允價值進行估值。

(2) 未上市股票的估值：

- ① 首次發行未上市的股票，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本價估值；
- ② 送股、轉增股、配股和公開增發新股等發行未上市的股票，按估值日在證券交易所上市的同一股票的估值價格進行估值；該日無交易的，以最近一日的收市價估值；
- ③ 首次公開發行有明確鎖定期限的股票，同一股票在交易所上市後，按估值日在證券交易所上市的同一股票的估值方法估值；

- ④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
- (3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认定为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
- (4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、 固定收益证券的估值方法：

- (1) 证券交易所市场交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人 与托管人另行协商约定；
- (2) 证券交易所市场未实行净价交易的固定收益品种按估值日收市价减去固定收益品种收市价中所含的应收利息（自固定收益品种计息起始日或上一 起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，最 近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日固定收益品种收市 价减去固定收益品种收市价中所含的固定收益品种应收利息得到的净价 进行估值；
- (3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技 术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
- (4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价 值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

- (5) 在全國銀行間債券市場交易的債券、資產支持證券等固定收益品種，採用估值技術確定公允價值。
- (6) 同一債券同時在兩個或兩個以上市場交易的，按債券所處的市場分別估值。
- (7) 在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1)–(6)小項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人認為按本項第(1)–(6)小項規定的方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人在綜合考慮市場成交價、市場報價、流動性、收益率曲線等多種因素基礎上形成的債券估值，基金管理人可根據具體情況與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。
- (8) 國家有最新規定的，按其規定進行估值。

3、 權證估值方法：

- (1) 基金持有的權證，從持有確認日起到賣出日或行權日止，上市交易的權證按估值日在證券交易所掛牌的該權證的收市價估值；估值日沒有交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，按最近交易日的收市價估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格。
- (2) 首次發行未上市的權證，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值。
- (3) 因持有股票而享有的配股權，以及停止交易、但未行權的權證，採用估值技術確定公允價值進行估值。
- (4) 在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1)–(3)項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人認為按本項第(1)–(3)項規定的方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可根據具體情況，並與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。

(5) 國家有最新規定的，按其規定進行估值。

4、 其他有價證券等資產按國家有關規定進行估值。

(五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人進行。基金單位淨值由基金管理人完成估值後，將估值結果以書面形式報給基金託管人，基金託管人按基金合同規定的估值方法、時間、程序進行覆核，基金託管人覆核無誤後簽章返回給基金管理人，由基金管理人依據本基金合同和有關法律法規的規定予以公佈。月末、年中和年末估值覆核與基金會計賬目的核對同時進行。

(六) 估值錯誤的處理

基金管理人和基金託管人將採取必要、適當、合理的措施確保基金資產估值的準確性、及時性。

本基金合同的當事人應按照以下約定處理：

1、 差錯類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人或註冊登記機構或代銷機構或投資者自身的過錯造成差錯，導致其他當事人遭受損失的，差錯的責任人應當對由於該差錯遭受損失的當事人（「受損方」）按下述「差錯處理原則」給予賠償，承擔賠償責任。

上述差錯的主要類型包括但不限於：資料申報差錯、數據傳輸差錯、數據計算差錯、系統故障差錯、下達指令差錯等；對於因技術原因引起的差錯，若系同行業現有技術水平不能預見、不能避免、不能克服，則屬不可抗力，按照下述規定執行。

由於不可抗力原因造成投資者的交易資料丟失或被錯誤處理或造成其他差錯，因不可抗力原因出現差錯的當事人不對其他當事人承擔賠償責任，但因該差錯取得不當得利的當事人仍應負有退還不當得利的義務。

2、 差錯處理原則

- (1) 差錯已發生，但尚未給當事人造成損失時，差錯責任方應及時協調各方，及時進行更正，因更正差錯發生的費用由差錯責任方承擔；由於差錯責任方未及時更正已產生的差錯，給當事人造成損失的，由差錯責任方承擔；若差錯責任方已經積極協調，並且有協助義務的當事人有足夠的時間進行更正而未更正，則其應當承擔相應賠償責任。差錯責任方應對更正的情況向有關當事人進行確認，確保差錯已得到更正；
- (2) 差錯的責任方對可能導致有關當事人的直接損失負責，不對間接損失負責，並且僅對差錯的有關直接當事人負責，不對第三方負責；
- (3) 因差錯而獲得不當得利的當事人負有及時退還不當得利的義務。但差錯責任方仍應對差錯負責。如果由於獲得不當得利的當事人不退還或不全部退還不當得利造成其他當事人的利益損失，則差錯責任方應賠償受損方的損失，並在其支付的賠償金額的範圍內對獲得不當得利的當事人享有要求交付不當得利的權利；如果獲得不當得利的當事人已經將此部分不當得利退還給受損方，則受損方應當將其已經獲得的賠償額加上已經獲得的不當得利退還的總和超過其實際損失的差額部分支付給差錯責任方；
- (4) 差錯調整採用盡量恢復至假設未發生差錯的正確情形的方式；
- (5) 差錯責任方拒絕進行賠償時，如果因基金管理人的行為造成基金資產損失時，基金託管人應為基金的利益向基金管理人追償，如果因基金託管人的行為造成基金資產損失時，基金管理人應為基金的利益向基金託管人追償。基金管理人和託管人之外的第三方造成基金資產的損失，並拒絕進行賠償時，由基金管理人負責向差錯方追償；
- (6) 如果出現差錯的當事人未按規定對受損方進行賠償，並且依據法律法規、基金合同或其他規定，基金管理人自行或依據法院判決、仲裁裁決對受損方承擔了賠償責任，則基金管理人有权向有責任的當事人進行追索，並有權要求其賠償或補償由此發生的費用和遭受的損失；

(7) 按法律法規規定的其他原則處理差錯。

3、 差錯處理程序

差錯被發現後，有關的當事人應當及時進行處理，處理的程序如下：

- (1) 查明差錯發生的原因，列明所有的當事人，並根據差錯發生的原因確定差錯的責任方；
- (2) 根據差錯處理原則或當事人協商的方法對因差錯造成的損失進行評估；
- (3) 根據差錯處理原則或當事人協商的方法由差錯的責任方進行更正和賠償損失；
- (4) 根據差錯處理的方法，需要修改基金註冊登記機構交易數據的，由基金註冊登記機構進行更正，並就差錯的更正向有關當事人進行確認。

4、 基金單位淨值差錯處理的原則和方法

- (1) 當基金單位淨值小數點後3位以內(含第3位)發生差錯時，視為基金單位淨值錯誤；基金單位淨值出現錯誤時，基金管理人應當立即予以糾正，通報基金託管人，並採取合理的措施防止損失進一步擴大；當錯誤達到或超過基金資產淨值的0.25%時，基金管理公司應當及時通知基金託管人並報中國證監會；錯誤偏差達到基金單位淨值的0.5%時，基金管理人應當公告、通報基金託管人並報中國證監會備案；當發生淨值計算錯誤時，由基金管理人負責處理，由此給基金單位持有人和基金造成損失的，應由基金管理人先行賠付，基金管理人按差錯情形，有權向其他當事人追償。
- (2) 當基金單位淨值計算差錯給基金和基金單位持有人造成損失需要進行賠償時，基金管理人和基金託管人應根據實際情況界定雙方承擔的責任，經確認後按以下條款進行賠償：
 - ① 本基金的基金會計責任方由基金管理人擔任，與本基金有關的會計問題，如經雙方在平等基礎上充分討論後，尚不能達成一致時，按基金會計責任方的建議執行，由此給基金單位持有人和基金造成的損失，由基金管理人負責賠付；

- ② 若基金管理人計算的基金單位淨值已由基金託管人覆核確認後公告，而且基金託管人未對計算過程提出疑義或要求基金管理人書面說明，單位淨值出錯且造成基金單位持有人損失的，應根據法律法規的規定對投資者或基金支付賠償金，就實際向投資者或基金支付的賠償金額，其中基金管理人承擔50%，基金託管人承擔50%；
 - ③ 如基金管理人和基金託管人對基金單位淨值的計算結果，雖然多次重新計算和核對，尚不能達成一致時，為避免不能按時公佈基金單位淨值的情形，以基金管理人的計算結果對外公佈，由此給基金單位持有人和基金造成的損失，由基金管理人負責賠付；
 - ④ 由於基金管理人提供的信息錯誤（包括但不限於基金申購或贖回金額等），進而導致基金單位淨值計算錯誤而引起的基金單位持有人和基金的損失，由基金管理人負責賠付。
- (3) 基金管理人和基金託管人由於各自技術系統設置而產生的淨值計算誤差，以基金管理人計算結果為準。
 - (4) 前述內容如法律法規或者監管部門另有規定的，從其規定。如果行業有通行做法，雙方當事人應本着平等和保護基金單位持有人利益的原則進行協商。

（七）暫停估值的情形

- 1、 基金投資所涉及的證券交易所遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；
- 2、 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金託管人無法準確評估基金資產價值時；
- 3、 佔基金相當比例的投資品種的估值出現重大轉變，而基金管理人為保障基金單位持有人的利益，已決定延遲估值；
- 4、 出現會導致基金管理人不能出售或評估基金資產的緊急事故時；

- 5、 當前一估值日基金資產淨值 50% 以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，應當暫停基金估值；
- 6、 法律法規、中國證監會和基金合同認定的其他情形。

(八) 基金淨值的確認

用於基金信息披露的基金淨值由基金管理人負責計算，基金託管人負責進行覆核。基金管理人應於每個工作日交易結束後將當日的淨值計算結果發送給基金託管人。基金託管人對淨值計算結果覆核確認後發送給基金管理人，由基金管理人依據本基金合同和有關法律法規的規定對基金淨值予以公佈。

基金單位淨值的計算精確到 0.001 元，小數點後第四位四捨五入。國家另有規定的，從其規定。

(九) 特殊情形的處理

- 1、 基金管理人或基金託管人按股票估值方法的第(3)項、債券估值方法的第(7)項、權證估值方法的第(4)項進行估值時，所造成的誤差不作為基金資產估值錯誤處理。
- 2、 由於證券交易所及登記結算公司發送的數據錯誤，有關會計制度變化或由於其他不可抗力原因，基金管理人和基金託管人雖然已經採取必要、適當、合理的措施進行檢查，但是未能發現該錯誤而造成的基金單位淨值計算錯誤，基金管理人、基金託管人可以免除賠償責任。但基金管理人、基金託管人應積極採取必要的措施消除由此造成的影響。

十二、基金的收益與分配

(一) 基金利潤的構成

基金利潤指基金利息收入、投資收益、公允價值變動收益和其他收入扣除相關費用後的餘額；基金已實現收益指基金利潤減去公允價值變動收益後的餘額。

(二) 基金可供分配利潤

基金可供分配利潤指截至收益分配基準日基金未分配利潤與未分配利潤中已實現收益中的較低者。

(三) 收益分配原則

本基金收益分配應遵循下列原則：

- 1、 本基金同一股份類別的每份基金單位享有同等分配權；
- 2、 在符合有關基金分派條件的前提下，本基金每年收益分配次數最多為4次，每份基金單位每次分配比例不得低於收益分配基準日每份基金單位可供分配利潤的30%；若基金合同生效不滿3個月，可不進行收益分配。可供分配利潤是指收益分配基準日本基金資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益中的較低者；
- 3、 基金收益分配基準日的每類基金單位淨值減去該類單位基金單位收益分配金額後不能低於面值；
- 4、 本基金收益分配方式分為兩種：現金股息與股息再投資，基金投資者可選擇現金股息或將現金股息自動轉為基金單位進行再投資；若投資者不選擇，本基金默認的收益分配方式是現金股息；
- 5、 基金實施收益分配的，基金股息發放日距離收益分配基準日（即可供分配利潤計算截止日）的時間不得超過15個工作日；
- 6、 法律法規或監管機構另有規定的從其規定。

在不影響投資者利益的情況下，基金管理人可在法律法規允許的前提下酌情調整以上基金收益分配原則，此項調整應於變更實施日前在指定媒體和基金管理人網站公告。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中應載明基金收益分配基準日可供分配利潤、基金收益分配對象、分配時間、分配數額及比例、分配方式等內容。

(五) 收益分配方案的確定、公告與實施

- 1、 本基金收益分配方案由基金管理人擬定、由基金託管人核實後確定，基金管理人按法律法規的規定公告。

- 2、 在分配方案公佈後(依據具體方案的規定)，基金管理人就支付的現金股息向基金託管人發送劃款指令，基金託管人按照基金管理人的指令及時進行股息資金的劃付。
- 3、 法律法規或監管機關另有規定的，從其規定。

(六) 收益分配中發生的費用

收益分配時所發生的銀行轉賬或其他手續費用由投資者自行承擔。當投資者的現金股息小於一定金額，不足於支付銀行轉賬或其他手續費用時，註冊登記機構可將基金單位持有人的現金股息自動轉為基金單位。股息再投資的計算方法，依照《業務規則》執行。

十三、基金的費用與稅收

(一) 基金費用的種類

- 1、 基金管理人的管理費；
- 2、 基金託管人的託管費；
- 3、 基金合同生效後的信息披露費用，但法律法規、中國證監會另有規定的除外；
- 4、 基金單位持有人大會費用；
- 5、 基金合同生效後與基金有關的會計師費和律師費；
- 6、 基金的證券交易費用；
- 7、 基金資產撥劃支付的銀行費用；
- 8、 按照國家有關規定可以在基金資產中列支的其他費用。

(二) 上述基金費用由基金管理人在法律法規規定的範圍內按照公允的市場價格確定，法律法規和基金合同另有規定時從其規定。

(三) 基金費用計提方法、計提標準和支付方式

1、 基金管理人的管理費

在通常情況下，基金管理費按前一日基金資產淨值的年費率計提。計算方法如下：

$H = E \times \text{年管理費率} \div \text{當年天數}$ ，本基金年管理費率為1.5%

H為每日應計提的基金管理費

E為前一日基金資產淨值

基金管理費每日計提，按月支付。由基金管理人向基金託管人發送基金管理費劃付指令，經基金託管人覆核後於次月首日起3個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人，若遇法定節假日、休息日，支付日期順延。

2、 基金託管人的託管費

在通常情況下，基金託管費按前一日基金資產淨值的年費率計提。計算方法如下：

$H = E \times \text{年託管費率} \div \text{當年天數}$ ，本基金年託管費率為0.25%

H為每日應計提的基金託管費

E為前一日基金資產淨值

基金託管費每日計提，按月支付。由基金管理人向基金託管人發送基金託管費劃付指令，經基金託管人覆核後於次月首日起3個工作日內從基金資產中一次性支付給基金託管人，若遇法定節假日、休息日，支付日期順延。

3、 上述(一)中3到7項費用由基金託管人根據其他有關法律法規及相應協議的規定，按費用支出金額支付，列入或攤入當期基金費用。

(四) 不列入基金費用的項目

基金管理人和基金託管人因未履行或未完全履行義務導致的費用支出或基金資產的損失，以及處理與基金運作無關的事項發生的費用等不列入基金費用。基金募集期間所發生的信息披露費、律師費和會計師費以及其他費用不從基金資產中支付。

(五) 基金管理人和基金託管人可根據基金發展情況調整基金管理費率和基金託管費率。降低基金管理費率和基金託管費率，無須召開基金單位持有人大會。基金管理人必須依照有關規定最遲於新的費率實施日前在指定媒體和基金管理人網站上刊登公告。

(六) 基金稅收

基金和基金單位持有人根據國家法律法規的規定，履行納稅義務。

十四、基金的會計與審計

(一) 基金的會計政策

- 1、 基金管理人為本基金的會計責任方；
- 2、 本基金的會計年度為公曆每年的1月1日至12月31日，如果基金合同生效所在的會計年度，基金合同生效少於3個月，可以併入下一個會計年度；
- 3、 本基金的會計核算以人民幣為記賬基本貨幣，以人民幣元為記賬單位；
- 4、 會計制度執行國家有關的會計制度；
- 5、 本基金獨立建賬、獨立核算；
- 6、 基金管理人及基金託管人分別保留完整的會計賬目、憑證並進行日常的會計核算，按照有關規定編製基金會計報表；
- 7、 基金託管人定期與基金管理人就基金的會計核算、報表編製等進行核對並書面確認。

(二) 基金的審計

- 1、 基金管理人聘請具有從事證券、期貨相關業務資格的會計師事務所及其註冊會計師對本基金年度財務報表及其他規定事項進行審計。會計師事務所及其註冊會計師與基金管理人、基金託管人相互獨立。
- 2、 會計師事務所更換經辦註冊會計師時，應事先徵得基金管理人和基金託管人同意。
- 3、 基金管理人(或基金託管人)認為有充足理由更換會計師事務所，經基金託管人(或基金管理人)同意可以更換。基金管理人應當依據有關規定在指定媒體上公告。

十五、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露應符合《基金法》、《運作辦法》、《信息披露辦法》、基金合同及其他有關規定。相關法律法規關於信息披露的規定發生變化時，本基金從其最新規定。

(二) 信息披露義務人

本基金信息披露義務人包括基金管理人、基金託管人、召集基金單位持有人大會的基金單位持有人及其日常機構(如有)等法律法規和中國證監會規定的自然人、法人和非法人組織。

本基金信息披露義務人以保護基金單位持有人利益為根本出發點，按照法律法規和中國證監會的規定披露基金信息，並保證所披露信息的真實性、準確性、完整性、及時性、簡明性和易得性。

本基金信息披露義務人應當在中國證監會規定時間內，將應予披露的基金信息通過中國證監會指定的全國性報刊(以下簡稱「指定報刊」)和指定的互聯網網站(以下簡稱「指定網站」，包括基金管理人網站、基金託管人網站、中國證監會基金電子披露網站)等媒介披露，並保證基金投資者能夠按照基金合同約定的時間和方式查閱或者複製公開披露的信息資料。

(三) 本基金信息披露義務人在承諾公開披露的基金信息時，不得有下列行為：

- 1、 虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏；
- 2、 對證券投資業績進行預測；
- 3、 違規承諾收益或者承擔損失；
- 4、 詆毀其他基金管理人、基金託管人或者基金基金銷售機構；
- 5、 登載任何自然人、法人和非法人組織的祝賀性、恭維性或推薦性的文字；
- 6、 中國證監會禁止的其他行為。

(四) 本基金公開披露的信息應採用中文文本。如同時採用外文文本的，基金信息披露義務人應保證不同文本的內容一致。不同文本之間發生歧義的，以中文文本為準。

本基金公開披露的信息採用阿拉伯數字；除特別說明外，貨幣單位為人民幣元。

(五) 公開披露的基金信息

公開披露的基金信息包括：

1、 招募說明書、基金產品資料概要、基金合同、託管協議、基金單位發售公告

- (1) 招募說明書應當最大限度地披露影響基金投資者決策的全部事項，說明基金認購、申購和贖回安排、基金投資、基金產品特性、風險披露、信息披露及基金單位持有人服務等內容。

基金產品資料概要是基金招募說明書的摘要文件，用以向投資者提供簡明的基金概要信息。基金管理人應當依照法律法規和中國證監會的規定編製、披露與更新基金產品資料概要。

基金合同生效後，基金招募說明書、基金產品資料概要的信息發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金招募說明書和基金產品資料概要，並登載在指定網站上，其中基金產品資料概要還應當登載在基金銷售機構網站或營業網點；基金招募說明書、基金產品資料概要其他信息發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。

基金終止運作的，基金管理人可以不再更新基金招募說明書和基金產品資料概要。

關於基金產品資料概要編製、披露與更新的要求，自中國證監會規定之日起開始執行。

- (2) 基金管理人應當就基金單位發售的具體事宜編製基金單位發售公告。
- (3) 基金合同是界定基金合同當事人的各項權利、義務關係，明確基金單位持有人大會召開的規則及具體程序，說明基金產品的特性等涉及基金投資者重大利益的事項的法律文件。
- (4) 託管協議是界定基金託管人和基金管理人在基金資產保管及基金運作監督等活動中的權利、義務關係的法律文件。

2、 基金合同生效公告

基金管理人應當在本基金合同生效的翌日在指定報刊和指定網站上登載基金合同生效公告。

3、 基金開始申購、贖回公告

基金管理人應於申購開始日、贖回開始日前在指定報刊和指定網站上公告。

4、 基金淨值信息公告

本基金合同生效後，在開始辦理基金單位申購或者贖回前，基金管理人應當至少每周在指定網站披露一次基金單位淨值和基金單位累計淨值。

在開始辦理基金單位申購或者贖回後，基金管理人應當在不遲於每個開放日的翌日，通過指定網站、申購贖回代理機構網站或者營業網點，披露開放日的基金單位淨值和基金單位累計淨值。

基金管理人應當在不遲於半年度和年度最後一日的翌日，在指定網站披露半年度和年度最後一日的基金單位淨值和基金單位累計淨值。

5、 基金定期報告，包括基金年度報告、基金中期報告和基金季度報告（含資產組合季度報告）

基金管理人應當在每年結束之日起三個月內，編製完成基金年度報告，並將年度報告登載於指定網站上，將年度報告提示性公告登載在指定報刊上。基金年度報告的財務會計報告應當經過具有證券、期貨相關業務資格的會計師事務所審計。

基金管理人應當在上半年結束之日起兩個月內，編製完成基金中期報告，並將中期報告正文登載在指定網站上，將中期報告提示性公告登載在指定報刊上。

基金管理人應當在季度結束之日起15個工作日內，編製完成基金季度報告，將季度報告登載在指定網站上，並將季度報告提示性公告登載在指定報刊上。

基金合同生效不足2個月的，基金管理人可以不編製當期季度報告、中期報告或者年度報告。

基金管理人應當在基金年度報告和半年度報告中披露基金組合資產情況及其流動性風險分析等。

報告期內出現單一投資者持有基金份額比例達到或者超過20%的情形，為保障其他投資者的權益，基金管理人至少應當在基金定期報告「影響投資者決策的其

他重要資訊」項下披露該投資者的類別、報告期末持有份額及佔比、報告期內持有份額變化情況及產品的特有風險，中國證監會認定的特殊情形除外。

6、 臨時報告

本基金發生重大事件，有關信息披露義務人應當按規定編製臨時報告書，並登載在指定報刊和指定網站上。

前款所稱重大事件，是指可能對基金單位持有人權益或者基金單位的價格產生重大影響的下列事件：

- (1) 基金單位持有人大會的召開及決定的事項；
- (2) 基金合同終止、基金清算；
- (3) 轉換基金運作方式、基金合併；
- (4) 更換基金管理人、基金託管人；
- (5) 基金管理人委託基金服務機構代為辦理基金的單位登記、核算、估值等事項，基金託管人委託基金服務機構代為辦理基金的核算、估值、覆核等事項；
- (6) 基金管理人、基金託管人的法定名稱、住所發生變更；
- (7) 基金管理公司變更持有百分之五以上股權的股東、變更公司的實際控制人；
- (8) 基金募集期延長或提前結束募集；
- (9) 基金管理人的高級管理人員、基金經理和基金託管人專門基金託管部門負責人發生變動；
- (10) 基金管理人的董事在最近12個月內變更超過50%；
- (11) 基金管理人、基金託管人專門基金託管部門的主要業務人員在最近12個月內變動超過30%；
- (12) 涉及基金管理業務、基金財產、基金託管業務的訴訟或仲裁；
- (13) 基金管理人或其高級管理人員、基金經理因基金管理業務相關行為受到重大行政處罰、刑事處罰，基金託管人或其專門基金託管部門負責人因基金託管業務相關行為受到重大行政處罰、刑事處罰；

- (14) 基金管理人運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易事項，中國證監會另有規定的情形除外；
- (15) 基金收益分配事項；
- (16) 管理費、託管費、申購費、贖回費等費用計提標準、計提方式和費率發生變更；
- (17) 基金單位淨值計價錯誤達基金單位淨值0.5%；
- (18) 基金改聘會計師事務所；
- (19) 基金更換基金單位登記機構；
- (20) 本基金開始辦理申購、贖回；
- (21) 本基金發生巨額贖回並延期辦理；
- (22) 本基金連續發生巨額贖回並暫停接受贖回申請或延緩支付贖回款項；
- (23) 本基金暫停接受申購、贖回申請或重新接受申購、贖回申請；
- (24) 本基金發生涉及基金申購、贖回事項調整或潛在影響投資者贖回等重大事項；
- (25) 基金推出新業務或服務；
- (26) 基金信息披露義務人認為可能對基金單位持有人權益或者基金單位的價格產生重大影響的其他事項或中國證監會規定的其他事項。

7、 澄清公告

在本基金合同存續期限內，任何公共媒體中出現的或者在市場上流傳的消息可能對基金單位價格產生誤導性影響或者引起較大波動的，以及可能損害基金單位持有人權益的，相關信息披露義務人知悉後應當立即對該消息進行公開澄清，並將有關情況立即報告中國證監會。

8、 基金單位持有人大會決議

基金單位持有人大會決定的事項，應當依法報中國證監會核准或者備案，並予以公告。召開基金單位持有人大會的，召集人應當至少提前30日公告基金單位持有人大會的召開時間、會議形式、審議事項、議事程序和表決方式等事項。

基金單位持有人依法自行召集基金單位持有人大會，基金管理人、基金託管人對基金單位持有人大會決定的事項不依法履行信息披露義務的，召集人應當履行相關信息披露義務。

9、清算報告

基金合同終止的，基金管理人應當依法組織基金財產清算小組對基金財產進行清算並作出清算報告。基金財產清算小組應當將清算報告登載在指定網站上，並將清算報告提示性公告登載在指定報刊上。

10、 中國證監會規定的其他信息。

(六) 信息披露事務管理

基金管理人、基金託管人應當建立健全信息披露管理制度，指定專門部門及高級管理人員負責管理信息披露事務。

基金管理人、基金託管人及相關從業人員不得泄露未公開披露的基金信息。

基金信息披露義務人公開披露基金信息，應當符合中國證監會相關基金信息披露內容與格式準則等法規的規定。

基金託管人應當按照相關法律法規、中國證監會的規定和基金合同的約定，對基金管理人編製的基金資產淨值、基金單位淨值、基金單位申購、贖回價格、基金定期報告、更新的招募說明書、基金產品資料概要、基金清算報告等公開披露的相關基金信息進行覆核、審查，並向基金管理人進行書面或電子確認。

基金管理人、基金託管人應當在指定報刊中選擇披露信息的報刊，單隻基金只需選擇一家報刊。

基金管理人、基金託管人應當向中國證監會基金電子披露網站報送擬披露的基金信息，並保證相關報送信息的真實、準確、完整、及時。

為強化投資者保護，提升信息披露服務質量，基金管理人應當自中國證監會規定之日起，按照中國證監會規定向投資者及時提供對其投資決策有重大影響的信息。

基金管理人、基金託管人除按法律法規要求披露信息外，也可著眼於為投資者決策提供有用信息的角度，在保證公平對待投資者、不誤導投資者、不影響基金正常投資操作的前提下，自主提升信息披露服務的質量。具體要求應當符合中國證監會相關規定。前述自主披露如產生信息披露費用，該費用不得從基金財產中列支。

(七) 信息披露文件的存放與查閱

依法必須披露的信息發布後，基金管理人、基金託管人應當按照相關法律法規規定將信息置備於公司住所，以供社會公眾查閱、複製。

投資者在支付手續費後，可在合理時間內取得上述文件複製件或複印件。

十六、風險披露

(一) 投資本基金的風險

1、市場風險

基金主要投資於證券市場，而證券市場價格因受到經濟因素、政治因素、投資者心理和交易制度等各種因素的影響而產生波動，從而導致基金收益水平發生變化，產生風險。主要的風險因素包括：

- (1) 政策風險。因財政政策、貨幣政策、產業政策、地區發展政策等國家宏觀政策發生變化，導致市場價格波動，影響基金收益而產生風險。
- (2) 經濟周期風險。證券市場是國民經濟的晴雨表，隨着經濟運行的周期性變化，證券市場的收益水平也呈周期性變化，基金投資的收益水平也會隨之變化，從而產生風險。
- (3) 利率風險。金融市場利率的波動會導致證券市場價格和收益率的變動。利率直接影響着債券的價格和收益率，影響着企業的融資成本和利潤。基金投資於債券和股票，其收益水平可能會受到利率變化的影響。

- (4) 上市公司經營風險。上市公司的經營狀況受多種因素的影響，如管理能力、行業競爭、市場前景、技術更新、新產品研究開發等都會導致公司盈利發生變化。如果基金所投資的上市公司經營不善，其股票價格可能下跌，或者能夠用於分配的利潤減少，使基金投資收益下降。雖然基金可以通過投資多樣化來分散這種非系統風險，但不能完全避免。
- (5) 購買力風險。基金單位持有人收益將主要通過現金形式來分配，而現金可能因為通貨膨脹因素而使其購買力下降，從而使基金的實際收益下降。

2、 管理風險

- (1) 在基金管理運作過程中，基金管理人的知識、經驗、判斷、決策、技能等，會影響其對信息的佔有以及對經濟形勢、證券價格走勢的判斷，從而影響基金收益水平。
- (2) 基金管理人和基金託管人的管理手段和管理技術等因素的變化也會影響基金收益水平。

3、 流動性風險

基金的流動性風險主要表現在兩方面：一是基金管理人建倉時或為實現投資收益而進行組合調整時，可能會由於個股的市場流動性相對不足而無法按預期的價格將股票或債券買進或賣出；二是為應付投資者的贖回，當個股的流動性較差時，基金管理人被迫在不適當的價格大量拋售股票或債券。兩者均可能使基金淨值受到不利影響。

基金管理人將充分考慮本基金所面臨的流動性風險，始終關注並採取有效的措施勤勉管理基金的流動性，以確保公平對待所有投資者，保證基金的交易安排在整個產品存續期內均適合其投資策略和所投資的標的資產。

基金管理人已經建立了流動性風險管理總體框架，並確定了不同的流動性風險管理工具，以適應不同基金或策略的特定要求。基金管理人將採取最大的努力以降低流動性風險的影響，上述工具的設計也是為了達到此目的，儘管如此，流動性風險仍無法完全消除。

4、 特定風險

本基金力爭把握經濟結構調整和產業升級的發展趨勢，精選新興產業中的優質上市公司和傳統產業中具備新成長動力的上市公司股票，因此本基金的特定風險主要來自兩方面：一是對經濟結構調整和產業升級的理解偏差導致對行業和個股的判斷不夠準確；二是對上市公司的基本面研究不夠深入導致個股選擇失誤。

5、 操作或技術風險

相關當事人在業務各環節操作過程中，因內部控制存在缺陷或者人為因素造成操作失誤或違反操作規程等引致的風險，例如，越權違規交易、會計部門欺詐、交易錯誤、IT系統故障等風險。

在開放式基金的各種交易行為或者後台運作中，可能因為技術系統的故障或者差錯而影響交易的正常進行或者導致基金單位持有人的利益受到影響。這種技術風險可能來自基金管理公司、註冊登記機構、代銷機構、證券交易所、證券登記結算機構等等。

6、 合規性風險

指基金管理或運作過程中，違反國家法律、法規的規定，或者基金投資違反法規及基金合同有關規定的風險。

7、 投資科創板股票存在的風險包括：

(1) 科創板股票的流動性風險

科創板投資門檻高，個人投資者需要滿足一定條件才可參與科創板股票投資，科創板股票流動性可能遜於其他市場板塊，若機構投資者對個股形成一致預期，存在股票無法成交的風險。

(2) 科創板企業退市風險

科創板有更為嚴格的退市標準，且不設暫停上市、恢復上市和重新上市制度，科創板上市企業退市風險更大，可能會為本基金帶來不利影響。

(3) 投資集中度風險

科創板為新設板塊，初期可投標的較少，投資者容易集中投資於少量個股，市場可能存在高集中度狀況，整體存在集中度風險。

(4) 市場風險

科創板個股集中來自新一代資訊技術、高端裝備、新物料、新能源、節能環保及生物醫藥等高新技術和策略新興產業領域。大多數企業為初創型公司，企業未來盈利、現金流、估值均存在不明朗因素，與傳統二級市場投資存在差異，整體投資難度加大，個股市場風險加大。

科創板個股上市前五日無漲跌停限制，第六日開始漲跌幅限制在正負20%以內，個股波動幅度較其他股票加大，市場風險隨之上升。

(5) 系統性風險

科創板企業均為市場認可度較高的科技創新企業，在企業經營及盈利模式上趨同，因此科創板個股相關性較高，市場表現欠佳時，系統性風險將更為顯著。

(6) 股價波動風險

科創板新股發行價格、規模、節奏等堅持市場化導向，詢價、定價、配售等環節由機構投資者主導。科創板新股發行全部採用詢價定價方式，詢價物件限定在證券公司等七類專業機構投資者，而個人投資者無法直接參與發行定價。同時，因科創板企業普遍具有技術新、前景不確定、業績波動大、風險高等特徵，市場可比公司較少，傳統估值方法可能不適用，發行定價難度較大，科創板股票上市後可能存在股價波動的風險。

(7) 政策風險

國家對高新技術產業扶持力度及重視程度的變化會對科創板企業帶來較大影響，國際經濟形勢變化對策略新興產業及科創板個股亦會帶來政策影響。

8、 其他風險

- 1) 因技術因素而產生的風險，如電腦系統不可靠產生的風險；
- 2) 因基金業務快速發展而在制度建設、人員配備、內部控制制度建立等方面不完善而產生的風險；
- 3) 因人為因素而產生的風險，如內幕交易、欺詐等行為產生的風險；
- 4) 對主要業務人員如基金經理的依賴而可能產生的風險；
- 5) 因戰爭、自然災害等不可抗力導致的基金管理人、基金代銷機構等機構無法正常工作，從而影響基金的申購、贖回按正常時限完成的風險。

(二) 聲明

- 1、 本基金未經任何一級政府、機構及部門擔保。基金投資者自願投資於本基金，須自行承擔投資風險。
- 2、 除基金管理人直接辦理本基金的銷售外，本基金還通過基金代銷機構代理銷售，但是，基金資產並不是代銷機構的存款或負債，也沒有經基金代銷機構擔保收益，代銷機構並不能保證其收益或本金安全。

十七、基金合同的變更、終止與基金資產的清算

(一) 基金合同的變更

- 1、 按照法律法規或本基金合同的規定，對基金合同的變更應當召開基金單位持有人大會的，基金合同變更的內容應經基金單位持有人大會決議通過，並依法報中國證監會核准，自中國證監會核准之日起生效。
- 2、 但出現下列情況時，可不經基金單位持有人大會決議，由基金管理人和基金託管人同意變更後公佈經修訂的基金合同，並報中國證監會備案：
 - (1) 調低基金管理費、基金託管費；
 - (2) 在法律法規和本基金合同規定的範圍內調整基金的申購費率、贖回費率或變更收費方式；

- (3) 因相應的法律法規發生變動必須對基金合同進行修改；
- (4) 基金合同的修改不涉及本基金合同當事人權利義務關係；
- (5) 基金合同的修改對基金單位持有人利益無實質性不利影響；
- (6) 按照法律法規或本基金合同規定不需召開基金單位持有人大會的其他情形。

(二) 本基金合同的終止

有下列情形之一的，本基金合同經中國證監會核准後將終止：

- 1、 基金單位持有人大會決定終止的；
- 2、 基金管理人職責終止，而在6個月內沒有新的基金管理人承接的；
- 3、 基金託管人職責終止，而在6個月內沒有新的基金託管人承接的；
- 4、 相關法律法規和中國證監會規定的其他情況。

(三) 基金資產的清算

1、 基金資產清算小組

- (1) 基金合同終止後，成立基金清算小組，基金清算小組在中國證監會的監督下進行基金清算。
- (2) 基金清算小組成員由基金管理人、基金託管人、具有從事證券、期貨相關業務資格的註冊會計師、律師以及中國證監會指定的人員組成。基金清算小組可以聘用必要的工作人員。
- (3) 基金清算小組負責基金資產的保管、清理、估價、變現和分配。基金清算小組可以依法進行必要的民事活動。

2、 基金資產清算程序

- (1) 基金合同終止時，由基金清算小組統一接管基金資產；
- (2) 對基金資產進行清理和確認；
- (3) 對基金資產進行估價和變現；

- (4) 製作清算報告；
- (5) 聘請會計師事務所對清算報告進行審計；
- (6) 聘請律師事務所對清算報告作出法律意見書；
- (7) 將基金清算結果報告中國證監會；
- (8) 公佈基金清算報告；
- (9) 對基金剩餘資產進行分配。

3、 清算費用

清算費用是指基金清算小組在進行基金清算過程中發生的所有合理費用，清算費用由基金清算小組優先從基金資產中支付。

4、 基金資產按下列順序清償：

- (1) 支付清算費用；
- (2) 交納所欠稅款；
- (3) 清償基金債務；
- (4) 按基金單位持有人持有的基金單位比例進行分配。

基金資產未按前款(1)–(3)項規定清償前，不分配給基金單位持有人。

5、 基金資產清算的公告

基金資產清算報告於基金合同終止並報中國證監會備案後5個工作日內由基金清算小組公告；清算過程中的有關重大事項須及時公告；基金資產清算結果經會計師事務所審計，律師事務所作出法律意見書後，由基金資產清算小組報中國證監會備案並公告。

6、 基金資產清算賬冊及文件的保存

基金資產清算賬冊及有關文件由基金託管人保存15年以上。

十八、基金合同的內容摘要

一、 基金的基本情況

基金名稱：上投摩根新興動力混合型證券投資基金

基金的類別：混合型證券投資基金

基金的運作方式：契約型開放式

核准文號：中國證監會證監基金字[2011]604號

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金託管人：中國農業銀行股份有限公司

二、 基金單位持有人、基金管理人及基金託管人的權利義務

(一) 基金單位持有人的權利義務

基金投資者依照招募說明書、基金合同取得基金單位即成為基金單位持有人和基金合同當事人，直至其不再持有本基金的基金單位，其持有基金單位的行為本身即表明其對基金合同的完全承認和接受。基金單位持有人作為基金合同當事人並不以在基金合同上書面簽章或簽字為必要條件。

同一股份類別每份基金單位具有同等的合法權益。

1、 根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關法律法規的規定，基金單位持有人的權利包括但不限於：

- (1) 分享基金資產收益；
- (2) 參與分配清算後的剩餘基金資產；
- (3) 依法轉讓或者申請贖回其持有的基金單位；
- (4) 按照規定要求召開基金單位持有人大會；
- (5) 出席或者委派代表出席基金單位持有人大會，對基金單位持有人大會審議事項行使表決權；
- (6) 查閱或者複製公開披露的基金信息資料；
- (7) 監督基金管理人的投資運作；
- (8) 對基金管理人、基金託管人、基金單位代銷機構損害其合法權益的行為依法提起訴訟；
- (9) 法律法規和基金合同規定的其他權利。

- 2、 根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關法律法規的規定，基金單位持有人的義務包括但不限於：
- (1) 遵守法律法規、基金合同及其他有關規定；
 - (2) 繳納基金認購、申購款項及法律法規、基金合同和招募說明書規定的費用；
 - (3) 在持有的基金單位範圍內，承擔基金虧損或者基金合同終止的有限責任；
 - (4) 不從事任何有損基金及其他基金單位持有人合法權益的活動；
 - (5) 執行生效的基金單位持有人大會決議；
 - (6) 遵守基金管理人、基金託管人及銷售機構和註冊登記機構的相關交易及業務規則；
 - (7) 退還在基金交易過程中因任何原因，自基金管理人、基金託管人及基金管理人的代理人處獲得的不當得利；
 - (8) 法律法規和基金合同規定的其他義務。

(二) 基金管理人的權利義務

1、 基金管理人的權利

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有關法律法規和本基金合同的規定獨立運用基金資產；
- (2) 依照本基金合同獲得基金管理人報酬以及法律法規規定或中國證監會批准的其他費用；
- (3) 依照有關規定為基金的利益行使因基金資產投資於證券所產生的權利；
- (4) 在符合有關法律法規和本基金合同的前提下，制定和調整有關基金認購、申購、贖回、轉換、非交易過戶、轉託管等業務的規則，決定基金的除調高託管費和管理費之外的費率結構和收費方式；

- (5) 根據本基金合同及有關規定監督基金託管人，對於基金託管人違反了本基金合同或有關法律法規規定的行為，對基金資產、其他基金當事人的利益造成重大損失的情形，應及時呈報中國證監會和銀行業監督管理機構，並採取必要措施保護基金及相關基金當事人的利益；
- (6) 在基金合同約定的範圍內，拒絕或暫停受理申購、贖回和轉換申請；
- (7) 自行擔任基金註冊登記機構或選擇、更換註冊登記機構，並對註冊登記機構的代理行為進行必要的監督和檢查；
- (8) 選擇、更換代銷機構，並依據銷售代理協議和有關法律法規，對其行為進行必要的監督和檢查；
- (9) 在基金託管人更換時，提名新的基金託管人；
- (10) 依法召集基金單位持有人大會；
- (11) 選擇、更換律師事務所、會計師事務所、證券經紀商或其他為基金提供服務的外部機構；
- (12) 根據國家有關規定，在法律法規允許的前提下，以基金的名義依法為基金融資、融券；
- (13) 法律法規規定的其他權利。

2、 基金管理人的義務

- (1) 依法募集基金，辦理或者委託經由證監會認定的其他機構代為辦理基金單位的發售、申購、贖回和註冊登記事宜；
- (2) 辦理基金備案手續；
- (3) 自基金合同生效之日起，以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產；
- (4) 配備足夠的具有專業資格的人員進行基金投資分析、決策，以專業化的經營方式管理和運作基金資產；

- (5) 建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，保證所管理的基金資產和基金管理人的財產相互獨立，對所管理的不同基金資產分別管理，分別記賬，進行證券投資；
- (6) 除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定外，不得為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人運作基金資產；
- (7) 依法接受基金託管人的監督；
- (8) 計算並公告基金淨值信息，確定基金單位申購、贖回價格；
- (9) 採取適當合理的措施使計算基金單位認購、申購、贖回價格的方法符合基金合同等法律文件的規定；
- (10) 按規定受理基金單位的申購和贖回申請，及時、足額支付贖回款項；
- (11) 進行基金會計核算並編製基金財務會計報告；
- (12) 編製中期和年度基金報告；
- (13) 嚴格按照《基金法》、基金合同及其他有關規定，履行信息披露及報告義務；
- (14) 保守基金商業秘密，不得泄露基金投資計劃、投資意向等。除《基金法》、基金合同及其他有關規定另有規定外，在基金信息公開披露前應予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金單位持有人分配收益；
- (16) 依據《基金法》、基金合同及其他有關規定召集基金單位持有人大會或配合基金託管人、基金單位持有人依法召集基金單位持有人大會；
- (17) 保存基金資產管理業務活動的記錄、賬冊、報表和其他相關資料；

- (18) 以基金管理人名義，代表基金單位持有人利益行使訴訟權利或者實施其他法律行為；
- (19) 組織並參加基金資產清算小組，參與基金資產的保管、清理、估價、變現和分配；
- (20) 因違反基金合同導致基金資產的損失或損害基金單位持有人合法權益，應當承擔賠償責任，其賠償責任不因其退任而免除；
- (21) 基金託管人違反基金合同造成基金資產損失時，應為基金單位持有人利益向基金託管人追償；
- (22) 按規定向基金託管人提供基金單位持有人名冊資料；
- (23) 建立並保存基金單位持有人名冊；
- (24) 面臨解散、依法被撤銷或者被依法宣告破產時，及時報告中國證監會並通知基金託管人；
- (25) 執行生效的基金單位持有人大會的決定；
- (26) 不從事任何有損基金及其他基金合同當事人合法權益的活動；
- (27) 依照法律法規為基金的利益對被投資公司行使股東權利，為基金的利益行使因基金資產投資於證券所產生的權利，不謀求對上市公司的控股和直接管理；
- (28) 法律法規、基金合同規定的以及中國證監會要求的其他義務。

(三) 基金託管人的權利義務

1、 基金託管人的權利

- (1) 獲得基金託管費；
- (2) 監督基金管理人對本基金的投資運作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金資產；
- (4) 在基金管理人更換時，提名新任基金管理人；

- (5) 根據本基金合同及有關規定監督基金管理人，對於基金管理人違反本基金合同或有關法律法規規定的行為，對基金資產、其他基金合同當事人的利益造成重大損失的情形，應及時呈報中國證監會，並採取必要措施保護基金及相關基金合同當事人的利益；
- (6) 依法召集基金單位持有人大會；
- (7) 按規定取得基金單位持有人名冊；
- (8) 法律法規規定的其他權利。

2、 基金託管人的義務

- (1) 以誠實信用、勤勉盡責的原則持有並安全保管基金資產；
- (2) 設立專門的基金託管部，具有符合要求的營業場所，配備足夠的、合格的熟悉基金託管業務的專職人員，負責基金資產託管事宜；
- (3) 建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，確保基金資產的安全，保證其託管的基金資產與基金託管人自有財產以及不同的基金資產相互獨立；對所託管的不同基金資產分別設置賬戶，獨立核算，分賬管理，保證不同基金之間在名冊登記、賬戶設置、資金劃撥、賬冊記錄等方面相互獨立；
- (4) 除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定外，不得為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人託管基金資產；
- (5) 保管由基金管理人代表基金簽訂的與基金有關的重大合同及有關憑證；
- (6) 按規定開設基金資產的資金賬戶和證券賬戶；
- (7) 保守基金商業秘密。除《基金法》、基金合同及其他有關規定另有規定外，在基金信息公開披露前應予保密，不得向他人泄露；

- (8) 對基金財務會計報告、中期和年度基金報告作出意見，說明基金管理人在各重要方面的運作是否嚴格按照基金合同的規定進行；如果基金管理人未執行基金合同規定的行為，還應當說明基金託管人是否採取了適當的措施；
- (9) 保存基金託管業務活動的記錄、賬冊、報表和其他相關資料不少於15年；
- (10) 按照基金合同的約定，根據基金管理人的投資指令，及時辦理清算、交割事宜；
- (11) 辦理與基金託管業務活動有關的信息披露事項；
- (12) 覆核、審查基金管理人計算的基金淨值信息和基金單位申購、贖回價格；
- (13) 按照規定監督基金管理人的投資運作；
- (14) 按規定製作相關賬冊並與基金管理人核對；
- (15) 依據基金管理人的指令或有關規定向基金單位持有人支付基金收益和贖回款項；
- (16) 按照規定召集基金單位持有人大會或配合基金單位持有人依法自行召集基金單位持有人大會；
- (17) 因違反基金合同導致基金資產損失，應承擔賠償責任，其賠償責任不因其退任而免除；
- (18) 按規定監督基金管理人按照法律法規規定和基金合同履行其義務，基金管理人因違反基金合同造成基金資產損失時，應為基金向基金管理人追償；

- (19) 根據本基金合同和託管協議規定建立並保存基金單位持有人名冊；
- (20) 參加基金資產清算組，參與基金資產的保管、清理、估價、變現和分配；
- (21) 面臨解散、依法被撤銷、破產或者由接管人接管其資產時，及時報告中國證監會和中國銀監會，並通知基金管理人；
- (22) 執行生效的基金單位持有人大會的決定；
- (23) 法律法規、基金合同規定的以及中國證監會要求的其他義務。

三、 基金單位持有人大會召集、議事及表決的程序和規則

(一) 召開事由

- 1、 當出現或需要決定下列事由之一的，應當召開基金單位持有人大會：
 - (1) 終止基金合同；
 - (2) 轉換基金運作方式；
 - (3) 變更基金類別；
 - (4) 變更基金投資目標、投資範圍或投資策略；
 - (5) 變更基金單位持有人大會議事程序；
 - (6) 更換基金管理人、基金託管人；
 - (7) 提高基金管理人、基金託管人的報酬標準。但根據法律法規的要求提高該等報酬標準的除外；
 - (8) 本基金與其他基金的合併；
 - (9) 對基金合同當事人權利、義務產生重大影響，需召開基金單位持有人大會的變更基金合同等其他事項；
 - (10) 法律法規、基金合同或中國證監會規定的其他情形。

- 2、 出現以下情形之一的，可由基金管理人和基金託管人協商後修改，不需召開基金單位持有人大會：
 - (1) 調低基金管理費、基金託管費、其他應由基金或基金單位持有人承擔的費用；
 - (2) 在法律法規和本基金合同規定的範圍內調整基金的申購費率、調低贖回費率或變更收費方式；
 - (3) 因相應的法律法規發生變動必須對基金合同進行修改；
 - (4) 基金合同的修改不涉及本基金合同當事人權利義務關係發生變化；
 - (5) 基金合同的修改對基金單位持有人利益無實質性不利影響；
 - (6) 按照法律法規或本基金合同規定不需召開基金單位持有人大會的其他情形。

(二) 召集人和召集方式

- 1、 除法律法規或本基金合同另有約定外，基金單位持有人大會由基金管理人召集。基金管理人未按規定召集或者不能召集時，由基金託管人召集。
- 2、 基金託管人認為有必要召開基金單位持有人大會的，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起10日內決定是否召集，並書面告知基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自作出書面決定之日起60日內召開；基金管理人決定不召集，基金託管人仍認為有必要召開的，應當自行召集。
- 3、 代表基金單位10%以上(以上含本數，下同)的基金單位持有人認為有必要召開基金單位持有人大會的，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起10日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金單位持有人代表和基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自作出書面決定之日起60日內召開；基金管理人決定不召集，代表基金單位10%以上的基金單位持有人仍認為有必要召開的，應當向基金託管人提出書面提議。基金託管人應當自收到書面提議之日起10日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金單位持有人代表和基金管理人；基金託管人決定召集的，應當自作出書面決定之日起60日內召開。

- 4、 代表基金單位 10% 以上的基金單位持有人就同一事項要求召開基金單位持有人大會，而基金管理人、基金託管人都不召集的，代表基金單位 10% 以上的基金單位持有人有權自行召集基金單位持有人大會，但應當至少提前 30 日向中國證監會備案。
- 5、 基金單位持有人依法自行召集基金單位持有人大會的，基金管理人、基金託管人應當配合，不得阻礙、干擾。

(三) 召開基金單位持有人大會的通知時間、通知內容、通知方式

- 1、 基金單位持有人大會的召集人(以下簡稱「召集人」)負責選擇確定開會時間、地點、方式和權益登記日。召開基金單位持有人大會，召集人必須於會議召開日前 30 日在指定媒體網站公告。基金單位持有人大會通知須至少載明以下內容：
 - (1) 會議召開的時間、地點和出席方式；
 - (2) 會議擬審議的主要事項；
 - (3) 會議形式；
 - (4) 議事程序；
 - (5) 有權出席基金單位持有人大會的權益登記日；
 - (6) 授權委託書的內容要求(包括但不限於代理人身份、代理權限和代理有效期限等)、送達時間和地點；
 - (7) 表決方式；
 - (8) 會務常設聯絡人姓名、電話；
 - (9) 出席會議者必須準備的文件和必須履行的手續；
 - (10) 召集人需要通知的其他事項。

- 2、 採用通訊方式開會並進行表決的情況下，由召集人決定通訊方式和書面表決方式，並在會議通知中說明本次基金單位持有人大會所採取的具體通訊方式、委託的公證機關及其聯絡方式和聯絡人、書面表達意見的寄交的截止時間和收取方式。
- 3、 如召集人為基金管理人，還應另行書面通知基金託管人到指定地點對書面表決意見的計票進行監督；如召集人為基金託管人，則應另行書面通知基金管理人到指定地點對書面表決意見的計票進行監督；如召集人為基金單位持有人，則應另行書面通知基金管理人和基金託管人到指定地點對書面表決意見的計票進行監督。基金管理人或基金託管人拒不派代表對書面表決意見的計票進行監督的，不影響計票和表決結果。

(四) 基金單位持有人出席會議的方式

1、 會議方式

- (1) 基金單位持有人大會的召開方式包括現場開會和通訊方式開會。
- (2) 現場開會由基金單位持有人本人出席或通過授權委託書委派其代理人出席，現場開會時基金管理人和基金託管人的授權代表應當出席，基金管理人或基金託管人拒不派代表出席的，不影響表決效力。
- (3) 通訊方式開會指按照本基金合同的相關規定以通訊的書面方式進行表決。

2、 召開基金單位持有人大會的條件

(1) 現場開會方式

在同時符合以下條件時，現場會議方可舉行：

- 1) 經核對、匯總，到會者出示的在權益登記日持有基金單位的憑證顯示，全部有效憑證所對應的基金單位應佔權益登記日基金單位總數的50%以上(含50%，下同)；

- 2) 親自出席會議者持有基金單位持有人憑證和受託出席會議者作出的委託人持有基金單位的憑證及授權委託等文件符合有關法律法規和基金合同及會議通知的規定，並且持有基金單位的憑證與基金管理人持有的登記資料相符。

未能滿足上述條件的情況下，則召集人可另行確定並公告重新開會的時間（至少應在25個工作日後）和地點，但確定有權出席會議的基金單位持有人資格的權益登記日不變。

(2) 通訊開會方式

在同時符合以下條件時，通訊會議方可舉行：

- 1) 召集人按本基金合同規定公佈會議通知後，在2個工作日內連續公佈相關提示性公告；
- 2) 召集人在基金託管人（如果基金託管人為召集人，則為基金管理人）和公證機關的監督下按照會議通知規定的方式收取和統計基金單位持有人的書面表決意見，基金管理人或基金託管人經通知拒不參加收取和統計書面表決意見的，不影響表決效力；
- 3) 本人直接作出書面意見或授權他人代表作出書面意見的基金單位持有人所代表的基金單位應佔權益登記日基金單位總數的50%以上；
- 4) 直接作出書面意見的基金單位持有人或受託代表他人作出書面意見的代表，同時提交的持有基金單位的憑證和受託出席會議者作出的委託人持有基金單位的憑證和授權委託書等文件符合法律法規、基金合同和會議通知的規定，並與註冊登記機構記錄相符；

如果開會條件達不到上述的條件，則召集人可另行確定並公告重新表決的時間（至少應在25個工作日後），且確定有權出席會議的基金單位持有人資格的權益登記日不變。

(五) 議事內容與程序

1、 議事內容及提案權

- (1) 議事內容為本基金合同規定的召開基金單位持有人大會事由所涉及的內容以及會議召集人認為需提交基金單位持有人大會討論的其他事項。
- (2) 基金管理人、基金託管人、單獨或合併持有權益登記日本基金單位總數10%以上的基金單位持有人可以在大會召集人發出會議通知前就召開事由向大會召集人提交需由基金單位持有人大會審議表決的提案；也可以在會議通知發出後向大會召集人提交臨時提案，臨時提案應當在大會召開日前35日提交召集人。召集人對於臨時提案應當在大會召開日前30日公告。否則，會議的召開日期應當順延並保證至少與臨時提案公告日期有30日的間隔期。
- (3) 對於基金單位持有人提交的提案(包括臨時提案)，大會召集人應當按照以下原則對提案進行審核：

關聯性。大會召集人對於基金單位持有人提案涉及事項與基金有直接關係，並且不超出法律法規和基金合同規定的基金單位持有人大會職權範圍的，應提交大會審議；對於不符合上述要求的，不提交基金單位持有人大會審議。如果召集人決定不將基金單位持有人提案提交大會表決，應當在該次基金單位持有人大會上進行解釋和說明。

程序性。大會召集人可以對基金單位持有人的提案涉及的程序性問題作出決定。如將其提案進行分拆或合併表決，需徵得原提案人同意；原提案人不同意變更的，大會主持人可以就程序性問題提請基金單位持有人大會作出決定，並按照基金單位持有人大會決定的程序進行審議。

- (4) 單獨或合併持有權益登記日基金單位總數10%以上的基金單位持有人提交基金單位持有人大會審議表決的提案、基金管理人或基金託管人提交基金單位持有人大會審議表決的提案，未獲基金單位持有人大會審議通過，就同一提案再次提請基金單位持有人大會審議，其時間間隔不少於6個月。法律法規另有規定的除外。

- (5) 基金單位持有人大會的召集人發出召開會議的通知後，如果需要對原有提案進行修改，應當最遲在基金單位持有人大會召開日前30日公告。否則，會議的召開日期應當順延並保證至少與公告日期有30日的間隔期。

2、 議事程序

(1) 現場開會

在現場開會的方式下，首先由大會主持人按照規定程序宣佈會議議事程序及注意事項，確定和公佈監票人，然後由大會主持人宣讀提案，經討論後進行表決，經合法執業的律師見證後形成大會決議。

大會由基金管理人授權代表主持。在基金管理人授權代表未能主持大會的情況下，由基金託管人授權代表主持；如果基金管理人和基金託管人授權代表均未能主持大會，則由出席大會的基金單位持有人和代理人以所代表的基金單位50%以上多數選舉產生一名代表作為該次基金單位持有人大會的主持人。基金管理人和基金託管人不出席或主持基金單位持有人大會，不影響基金單位持有人大會作出的決議的效力。

召集人應當製作出席會議人員的簽名冊。簽名冊載明參加會議人員姓名(或機構名稱)、身份證號碼、住所地址、持有或代表有表決權的基金單位、委託人姓名(或機構名稱)等事項。

(2) 通訊方式開會

在通訊表決開會的方式下，首先由召集人提前30日公佈提案，在所通知的表決截止日期第2日在公證機構監督下由召集人統計全部有效表決並形成決議。

- 3、 基金單位持有人大會不得對未事先公告的議事內容進行表決。

(六) 決議形成的條件、表決方式、程序

- 1、 基金單位持有人所持每一基金單位享有平等的表決權。
- 2、 基金單位持有人大會決議分為一般決議和特別決議：

(1) 一般決議

一般決議須經出席會議的基金單位持有人及其代理人所持表決權的50%以上通過方為有效，除下列(2)所規定的須以特別決議通過事項以外的其他事項均以一般決議的方式通過；

(2) 特別決議

特別決議須經出席會議的基金單位持有人及代理人所持表決權的三分之二以上通過方為有效；更換基金管理人、更換基金託管人、轉換基金運作方式、提前終止基金合同必須以特別決議通過方為有效。

- 3、 基金單位持有人大會決定的事項，應當依法報中國證監會核准，或者備案，並予以公告。
- 4、 採取通訊方式進行表決時，除非在計票時有充分的相反證據證明，否則表面符合法律法規和會議通知規定的書面表決意見即視為有效的表決，表決意見模糊不清或相互矛盾的視為棄權表決，但應當計入作出書面意見的基金單位持有人所代表的基金單位總數。
- 5、 基金單位持有人大會採取記名方式進行投票表決。
- 6、 基金單位持有人大會的各項提案或同一項提案內並列的各項議題應當分開審議、逐項表決。

(七) 計票

1、 現場開會

- (1) 如基金單位持有人大會由基金管理人或基金託管人召集，則基金單位持有人大會的主持人應當在會議開始後宣佈在出席會議的基金單位持有人和代理人中推舉兩名基金單位持有人代表與大會召集人授權的一名監督員共同擔任監票人；如大會由基金單位持有人自行召集或大會雖然由基金管理人或基金託管人召集，但是基金管理人或基金託管人未出席大會的，基金單位持有人大會的主持人應當在會議開始後宣佈在出席會議的基金單位持有人和代理人中推舉3名基金單位持有人擔任監票人。基金管理人或基金託管人不出席大會的，不影響計票的效力及表決結果。

- (2) 監票人應當在基金單位持有人表決後立即進行點票，由大會主持人當場公佈計票結果。
- (3) 如會議主持人對於提交的表決結果有懷疑，可以對投票數進行重新點票；如會議主持人未進行重新點票，而出席會議的基金單位持有人或代理人對會議主持人宣佈的表決結果有異議，其有權在宣佈表決結果後立即要求重新點票，會議主持人應當立即重新點票並公佈重新點票結果。重新點票僅限一次。
- (4) 計票過程應由公證機關予以公證。

2、 通訊方式開會

在通訊方式開會的情況下，計票方式為：由大會召集人授權的兩名監督員在基金託管人授權代表（如果基金託管人為召集人，則為基金管理人授權代表）的監督下進行計票，並由公證機關對其計票過程予以公證。基金管理人或基金託管人不派代表監督計票的，不影響計票效力及表決結果。但基金管理人或基金託管人應當至少提前兩個工作日通知召集人，由召集人邀請無直接利害關係的第三方擔任監督計票人員。

（八） 基金單位持有人大會決議報中國證監會核准或備案後的公告時間、方式

- 1、 基金單位持有人大會通過的一般決議和特別決議，召集人應當自通過之日起5日內報中國證監會核准或者備案。基金單位持有人大會決定的事項自中國證監會依法核准或者作出無異議意見之日起生效，並在生效後方可執行。
- 2、 生效的基金單位持有人大會決議對全體基金單位持有人、基金管理人、基金託管人均有約束力。基金管理人、基金託管人和基金單位持有人應當執行生效的基金單位持有人大會的決定。
- 3、 基金單位持有人大會決議應自生效之日起按規定在指定媒體和基金管理人網站公告。

- 4、 如果採用通訊方式進行表決，在公告基金單位持有人大會決議時，必須將公證書全文、公證機關、公證員姓名等一同公告。

四、 基金收益分配原則、執行方式

(一) 收益分配原則

本基金收益分配應遵循下列原則：

- 1、 本基金同一股份類別的每份基金單位享有同等分配權；
- 2、 在符合有關基金分派條件的前提下，本基金每年收益分配次數最多為4次，每份基金單位每次分配比例不得低於收益分配基準日每份基金單位可供分配利潤的30%；若基金合同生效不滿3個月，可不進行收益分配。可供分配利潤是指收益分配基準日本基金資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益中的較低者；
- 3、 基金收益分配基準日的每類基金單位淨值減去該類基金單位收益分配金額後不能低於面值；
- 4、 本基金收益分配方式分為兩種：現金股息與股息再投資，基金投資者可選擇現金股息或將現金股息自動轉為基金單位進行再投資；若投資者不選擇，本基金默認的收益分配方式是現金股息；
- 5、 基金實施收益分配的，基金股息發放日距離收益分配基準日（即可供分配利潤計算截止日）的時間不得超過15個工作日；
- 6、 法律法規或監管機構另有規定的從其規定。

在不影響投資者利益的情況下，基金管理人可在法律法規允許的前提下酌情調整以上基金收益分配原則，此項調整應於變更實施日前在指定媒體和基金管理人網站公告。

(二) 收益分配方案

基金收益分配方案中應載明基金收益分配基準日可供分配利潤、基金收益分配對象、分配時間、分配數額及比例、分配方式等內容。

(三) 收益分配方案的確定、公告與實施

- 1、 本基金收益分配方案由基金管理人擬定、由基金託管人核實後確定，基金管理人按法律法規的規定公告。
- 2、 在分配方案公佈後(依據具體方案的規定)，基金管理人就支付的現金股息向基金託管人發送劃款指令，基金託管人按照基金管理人的指令及時進行分派資金的劃付。
- 3、 法律法規或監管機關另有規定的，從其規定。

(四) 收益分配中發生的費用

收益分配時所發生的銀行轉賬或其他手續費用由投資者自行承擔。當投資者的現金股息小於一定金額，不足於支付銀行轉賬或其他手續費用時，註冊登記機構可將基金單位持有人的現金股息自動轉為基金單位。股息再投資的計算方法，依照《業務規則》執行。

五、 基金費用計提方法、計提標準和支付方式

(一) 基金費用的種類

- 1、 基金管理人的管理費；
- 2、 基金託管人的託管費；
- 3、 基金合同生效後的信息披露費用，但法律法規、中國證監會另有規定的除外；
- 4、 基金單位持有人大會費用；
- 5、 基金合同生效後與基金有關的會計師費和律師費；
- 6、 基金的證券交易費用；
- 7、 基金資產撥劃支付的銀行費用；
- 8、 按照國家有關規定可以在基金資產中列支的其他費用。

(二) 上述基金費用由基金管理人在法律法規規定的範圍內按照公允的市場價格確定，法律法規和基金合同另有規定時從其規定。

(三) 基金費用計提方法、計提標準和支付方式

1、 基金管理人的管理費

在通常情況下，基金管理費按前一日基金資產淨值的年費率計提。計算方法如下：

$H = E \times \text{年管理費率} \div \text{當年天數}$ ，本基金年管理費率為1.5%

H為每日應計提的基金管理費

E為前一日基金資產淨值

基金管理費每日計提，按月支付。由基金管理人向基金託管人發送基金管理費劃付指令，經基金託管人覆核後於次月首日起3個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人，若遇法定節假日、休息日，支付日期順延。

2、 基金託管人的託管費

在通常情況下，基金託管費按前一日基金資產淨值的年費率計提。計算方法如下：

$H = E \times \text{年託管費率} \div \text{當年天數}$ ，本基金年託管費率為0.25%

H為每日應計提的基金託管費

E為前一日基金資產淨值

基金託管費每日計提，按月支付。由基金管理人向基金託管人發送基金託管費劃付指令，經基金託管人覆核後於次月首日起3個工作日內從基金資產中一次性支付給基金託管人，若遇法定節假日、休息日，支付日期順延。

3、 上述(一)中3到7項費用由基金託管人根據其他有關法律法規及相應協議的規定，按費用支出金額支付，列入或攤入當期基金費用。

(四) 不列入基金費用的項目

基金管理人和基金託管人因未履行或未完全履行義務導致的費用支出或基金資產的損失，以及處理與基金運作無關的事項發生的費用等不列入基金費用。基金募集期間所發生的信息披露費、律師費和會計師費以及其他費用不從基金資產中支付。

(五) 基金管理人和基金託管人可根據基金發展情況調整基金管理費率和基金託管費率。降低基金管理費率和基金託管費率，無須召開基金單位持有人大會。基金管理人必須依照有關規定最遲於新的費率實施日前在指定媒體和基金管理人網站上刊登公告。

(六) 基金稅收

基金和基金單位持有人根據國家法律法規的規定，履行納稅義務。

六、基金資產的投資方向和投資限制

(一) 投資目標

本基金在把握經濟結構調整和產業升級的發展趨勢基礎上，充分挖掘新興產業發展中的投資機會，重點關注新興產業中的優質上市公司，並兼顧傳統產業中具備新成長動力的上市公司進行投資，在有效控制風險的前提下，追求基金資產的穩定增值。

(二) 投資理念

在國家經濟轉型的大背景下，通過對經濟結構調整和產業升級方向的前瞻性分析，把握新興產業崛起過程中的投資機會，同時挖掘傳統產業升級和傳統產業公司自身發展變革帶來的投資新機遇，力爭實現基金資產的長期穩健增值。

(三) 投資範圍

本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支持證券以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。

基金的投資組合比例為：股票等股本類資產佔基金資產的60%-95%，債券等固定收益類資產佔基金資產的0-40%，權證投資佔基金資產淨值的0-3%，現金或到期日在一年期以內的政府債券不低於基金資產淨值的5%，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。本基金將不低於80%的股票資產投資於新興產業中的優質上市公司和傳統產業中具備新成長動力的上市公司股票。

如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其他品種，基金管理人在履行適當程序後，可以將其納入投資範圍。

(四) 投資限制

本基金的投資組合將遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超過基金資產淨值的10%；
- (2) 本基金與由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司發行的證券，不超過該證券的10%；
- (3) 本基金管理人管理的全部開放式基金持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該公司可流通股票的15%；
- (4) 本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該公司可流通股票的30%；
- (5) 進入全國銀行間同業市場的債券回購融入的資金餘額不得超過基金資產淨值的40%。債券回購最長期限為1年，債券回購到期後不得展期；
- (6) 本基金參與股票發行申購，本基金所申報的金額不超過本基金的總資產，本基金所申報的股票數量不超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；
- (7) 保持不低於基金資產淨值5%的現金或者到期日在一年以內的政府債券，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等；
- (8) 本基金投資權證，在任何交易日買入的總金額，不超過上一交易日基金資產淨值的0.5%，基金持有的全部權證的市值不超過基金資產淨值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一權證的比例不超過該權證的10%。投資於其他權證的投資比例，遵從法律法規或監管部門的相關規定；

- (9) 本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的10%；本基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券的比例，不得超過該基金資產淨值的10%；基金管理人管理的全部證券投資基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的10%；本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過該基金資產淨值的20%；
- (10) 本基金投資於流動性受限資產的市值合計不得超過該基金資產淨值的15%。
- 因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；
- (11) 本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同約定的投資範圍保持一致；
- (12) 本基金不得違反基金合同中有關投資範圍、投資策略、投資比例的規定；
- (13) 法律法規或監管部門對上述比例限制另有規定的，從其規定。

基金管理人應當自基金合同生效之日起六個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。在符合相關法律法規規定的前提下，因證券市場波動、上市公司合併、基金規模變動等非本基金管理人的因素致使基金的投資組合不符合上述規定的投資比例的，除上述第(7)、(10)、(11)項外，基金管理人應當在10個交易日內進行調整。法律法規或監管部門另有規定的，從其規定。

若法律法規或監管部門取消上述限制，履行適當程序後，本基金投資可不受上述規定限制。

七、 基金資產淨值的計算方法和公告方式

(一) 估值方法

1、 股票估值方法：

(1) 上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在證券交易所的收市價估值；估值日無交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，以最近交易日的收市價估值；如果估值日無交易，且最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，將參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易日收市價，確定公允價值進行估值。

(2) 未上市股票的估值：

- ① 首次發行未上市的股票，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本價估值；
- ② 送股、轉增股、配股和公開增發新股等發行未上市的股票，按估值日在證券交易所上市的同一股票的估值價格進行估值；該日無交易的，以最近一日的收市價估值；
- ③ 首次公開發行有明確鎖定期的股票，同一股票在交易所上市後，按估值日在證券交易所上市的同一股票的估值方法進行估值；
- ④ 非公開發行的且在發行時明確一定期限鎖定期的股票，按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值。

- (3) 在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1)–(2)小項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人認為按本項第(1)–(2)小項規定的方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可根據具體情況，並與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。
- (4) 國家有最新規定的，按其規定進行估值。

2、 固定收益證券的估值方法：

- (1) 證券交易所市場交易或掛牌轉讓的固定收益品種，選取估值日第三方估值機構提供的相應品種對應的估值淨價估值，具體估值機構由基金管理人與託管人另行協商約定；
- (2) 證券交易所市場未實行淨價交易的固定收益品種按估值日收市價減去固定收益品種收市價中所含的應收利息（自固定收益品種計息起始日或上一起息日至估值當日的利息）得到的淨價進行估值，估值日沒有交易的，最近交易日後經濟環境未發生重大變化，按最近交易日固定收益品種收市價減去固定收益品種收市價中所含的固定收益品種應收利息得到的淨價進行估值；
- (3) 首次發行未上市債券採用估值技術確定的公允價值進行估值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值。
- (4) 交易所以大宗交易方式轉讓的資產支持證券，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本進行後續計量。
- (5) 在全國銀行間債券市場交易的債券、資產支持證券等固定收益品種，採用估值技術確定公允價值。
- (6) 同一債券同時在兩個或兩個以上市場交易的，按債券所處的市場分別估值。

- (7) 在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1)–(6)小項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人認為按本項第(1)–(6)小項規定的方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人在綜合考慮市場成交價、市場報價、流動性、收益率曲線等多種因素基礎上形成的債券估值，基金管理人可根據具體情況與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。
- (8) 國家有最新規定的，按其規定進行估值。

3、 權證估值方法：

- (1) 基金持有的權證，從持有確認日起到賣出日或行權日止，上市交易的權證按估值日在證券交易所掛牌的該權證的收市價估值；估值日沒有交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，按最近交易日的收市價估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格。
- (2) 首次發行未上市的權證，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值。
- (3) 因持有股票而享有的配股權，以及停止交易、但未行權的權證，採用估值技術確定公允價值進行估值。
- (4) 在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1)–(3)項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人認為按本項第(1)–(3)項規定的方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可根據具體情況，並與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。
- (5) 國家有最新規定的，按其規定進行估值。

4、 其他有價證券等資產按國家有關規定進行估值。

(二) 基金淨值信息公告

本基金合同生效後，在開始辦理基金單位申購或者贖回前，基金管理人應當至少每周在指定網站披露一次基金單位淨值和基金單位累計淨值。

在開始辦理基金單位申購或者贖回後，基金管理人應當在不遲於每個開放日的翌日，通過指定網站、申購贖回代理機構網站或者營業網點，披露開放日的基金單位淨值和基金單位累計淨值。

基金管理人應當在不遲於半年度和年度最後一日的翌日，在指定網站披露半年度和年度最後一日的基金單位淨值和基金單位累計淨值。

八、 基金合同的終止事由、程序與基金資產的清算

(一) 本基金合同的終止

有下列情形之一的，本基金合同經中國證監會核准後將終止：

- 1、 基金單位持有人大會決定終止的；
- 2、 基金管理人職責終止，而在6個月內沒有新的基金管理人承接的；
- 3、 基金託管人職責終止，而在6個月內沒有新的基金託管人承接的；
- 4、 相關法律法規和中國證監會規定的其他情況。

(二) 基金資產的清算

1、 基金資產清算小組

- (1) 基金合同終止後，成立基金清算小組，基金清算小組在中國證監會的監督下進行基金清算。
- (2) 基金清算小組成員由基金管理人、基金託管人、具有從事證券、期貨相關業務資格的註冊會計師、律師以及中國證監會指定的人員組成。基金清算小組可以聘用必要的工作人員。
- (3) 基金清算小組負責基金資產的保管、清理、估價、變現和分配。基金清算小組可以依法進行必要的民事活動。

2、 基金資產清算程序

- (1) 基金合同終止時，由基金清算小組統一接管基金資產；
- (2) 對基金資產進行清理和確認；
- (3) 對基金資產進行估價和變現；
- (4) 製作清算報告；
- (5) 聘請會計師事務所對清算報告進行審計；
- (6) 聘請律師事務所對清算報告作出法律意見書；
- (7) 將基金清算結果報告中國證監會；
- (8) 公佈基金清算報告；
- (9) 對基金剩餘資產進行分配。

3、 清算費用

清算費用是指基金清算小組在進行基金清算過程中發生的所有合理費用，清算費用由基金清算小組優先從基金資產中支付。

4、 基金資產按下列順序清償：

- (1) 支付清算費用；
- (2) 交納所欠稅款；
- (3) 清償基金債務；
- (4) 按基金單位持有人持有的基金單位比例進行分配。

基金資產未按前款(1)–(3)項規定清償前，不分配給基金單位持有人。

5、 基金資產清算的公告

基金資產清算報告於基金合同終止並報中國證監會備案後5個工作日內由基金清算小組公告；清算過程中的有關重大事項須及時公告；基金資產清算結果經會計師事務所審計，律師事務所作出法律意見書後，由基金資產清算小組報中國證監會備案並公告。

6、 基金資產清算賬冊及文件的保存

基金資產清算賬冊及有關文件由基金託管人保存 15 年以上。

九、 爭議解決方式

對於因本基金合同產生或與本基金合同有關的爭議，基金合同當事人應盡量通過協商、調解途徑解決。不願或者不能通過協商、調解解決的，任何一方均有權將爭議提交中國國際經濟貿易仲裁委員會，按照中國國際經濟貿易仲裁委員會屆時有效的仲裁規則進行仲裁。仲裁地點為北京市。仲裁裁決是終局的，對當事人均有約束力。

爭議處理期間，基金合同當事人應恪守各自的職責，繼續忠實、勤勉、盡責地履行基金合同規定的義務，維護基金單位持有人的合法權益。

本基金合同適用中華人民共和國法律並從其解釋。

十、 基金合同的存放地及投資者取得方式

本基金合同正本一式六份，除上報相關監管部門兩份外，基金管理人和基金託管人各持有兩份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印製成冊，供基金投資者在基金管理人、基金託管人、代銷機構和註冊登記機構辦公場所查閱。基金合同條款及內容應以基金合同正本為準。

十九、基金託管協議的內容摘要

(一) 託管協議當事人

1、 基金管理人：上投摩根基金管理有限公司(具體信息見本招募說明書第三條)

2、 基金託管人：中國農業銀行股份有限公司

名稱：中國農業銀行股份有限公司

註冊地址：北京市東城區建國門內大街69號

辦公地址：北京市西城區復興門內大街28號凱晨世貿中心東座

郵政編碼：100031

法定代表人：周慕冰

成立時間：2009年1月15日

基金託管資格批准文號：中國證監會證監基字[1998]23號

註冊資本：32,479,411.7萬元人民幣

存續期間：持續經營

經營範圍：吸收公眾存款；發放短期、中期、長期貸款；辦理國內外結算；辦理票據承兌與貼現；發行金融債券；代理發行、代理兌付、承銷政府債券；買賣政府債券、金融債券；從事同業拆借；買賣、代理買賣外匯；結匯、售匯；從事銀行卡業務；提供信用證服務及擔保；代理收付款項；提供保管箱服務；代理資金清算；各類匯兌業務；代理政策性銀行、外國政府和國際金融機構貸款業務；貸款承諾；組織或參加銀團貸款；外匯存款；外匯貸款；外匯匯款；外匯借款；發行、代理發行、買賣或代理買賣股票以外的外幣有價證券；外幣票據承兌和貼現；自營、代客外匯買賣；外幣兌換；外匯擔保；信貸調查、諮詢、見證業務；企業、個人財務顧問服務；證券公司客戶交易結算資金存管業務；證券投資基金託管業務；企業年金託管業務；產業投資基金託管業務；合格境外機構投資者境內證券投資託管業務；代理開放式基金業務；電話銀行、手機銀行、網上銀行業務；金融衍生產品交易業務；經國務院銀行業監督管理機構等監管部門批准的其他業務；保險兼業代理業務。

(二) 基金託管人對基金管理人的業務監督和核查

- 1、 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資範圍、投資對象進行監督。基金合同明確約定基金投資風格或證券選擇標準的，基金管理人應按照基金託管人要求的格式提供投資品種池和交易對手庫，以便基金託管人運用相關技術系統，對基金實際投資是否符合基金合同關於證券選擇標準的約定進行監督，對存在疑義的事項進行核查。

本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支持證券以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。

本基金的配置比例為股票等股本類資產佔基金資產的60%-95%，債券等固定收益類資產佔基金資產的0-40%，權證投資佔基金資產淨值的0-3%，現金或到期日在一年期以內的政府債券不低於基金資產淨值的5%，其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。本基金將不低於80%的股票資產投資於新興產業中的優質上市公司和傳統產業中具備新成長動力的上市公司股票。

如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其他品種，基金管理人在履行適當程序後，可以將其納入投資範圍。

- 2、 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資、融資、融券比例進行監督。基金託管人按下述比例和調整期限進行監督：
 - 1、 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超過基金資產淨值的10%；
 - 2、 本基金與本基金管理人管理的其他基金持有一家公司發行的證券，其市值不超過該證券的10%；
 - 3、 本基金管理人管理的且由本基金託管人託管的全部開放式基金持有一家上市公司發行的可流通股票，不超該公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的且由本基金託管人託管的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該公司可流通股票的30%；

- 4、 進入全國銀行間同業市場的債券回購融入的資金餘額不超過基金資產淨值的40%。債券回購最長期限為1年，債券回購到期後不得展期；
- 5、 本基金參與股票發行申購，本基金所申報的金額不超過本基金的總資產，本基金所申報的股票數量不超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；
- 6、 本基金在任何交易日買入權證的總金額，不得超過上一交易日基金資產淨值的5%；本基金持有的全部權證，其市值不得超過基金資產淨值的3%；本基金與本基金管理人管理的其他基金持有的同一權證，不得超過該權證的10%；
- 7、 本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的10%；本基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券的比例，不得超過該基金資產淨值的10%；本基金管理人管理的全部證券投資基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的10%；本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過該基金資產淨值的20%；
- 8、 保持不低於基金資產淨值5%的現金或者到期日在一年以內的政府債券、其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等；
- 9、 本基金持有一家上市公司的股票（含非公開發行），其公允價值不超過基金資產淨值的10%；本基金持有的所有受限證券，其公允價值不得超過本基金資產淨值的10%；本基金持有的同一受限證券，其公允價值不得超過本基金資產淨值的2%；
- 10、 本基金投資於流動性受限資產的市值合計不得超過該基金資產淨值的15%。
因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；
- 11、 本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同約定的投資範圍保持一致；

- 12、 本基金不得違反基金合同中有關投資範圍、投資策略、投資比例的規定；
- 13、 法律法規或監管部門對上述比例限制另有規定的，從其規定。

因證券市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述規定的投資比例的，除上述第8、10、11項外，基金管理人應當在10個交易日內進行調整。

基金管理人應當自基金合同生效之日起6個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。法律法規或監管部門另有規定的，從其規定。

上述投資組合限制條款中，若屬法律法規的強制性規定，則當法律法規或監管部門取消上述限制，在履行適當程序後，本基金投資可不受上述規定限制。

基金管理人應在出現可預見資產規模大幅變動的情況下，提前向基金託管人發函說明基金可能變動規模和公司應對措施，便於託管人實施交易監督。

基金託管人對基金投資的監督和檢查自基金合同生效之日起開始。

- 3、 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對本協議第十五條第九項基金投資禁止行為進行監督。基金託管人通過事後監督方式對基金管理人基金投資禁止行為和關聯交易進行監督。根據法律法規有關基金禁止從事關聯交易的規定，基金管理人和基金託管人相互提供與本機構有控股關係的股東、與本機構有其他重大利害關係的公司名單及有關關聯方交易證券名單。基金管理人和基金託管人有責任確保關聯交易名單的真實性、準確性、完整性，並負責及時將更新後的名單發送給對方。

若基金託管人發現基金管理人與關聯交易名單中列示的關聯方進行法律法規禁止基金從事的關聯交易時，基金託管人應及時提醒並協助基金管理人採取必要措施阻止該關聯交易的發生，如基金託管人採取必要措施後仍無法阻止關聯交

易發生時，基金託管人有權向中國證監會報告。對於基金管理人已成交的關聯交易，如基金託管人事前已嚴格遵循了監督流程仍無法阻止該關聯交易的發生，而只能按相關法律法規和交易所規則進行事後結算，則基金託管人不承擔由此造成的損失，並應向中國證監會報告。

- 4、基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金管理人參與銀行間債券市場進行監督。基金管理人應在基金投資運作之前向基金託管人提供經慎重選擇的、本基金適用的銀行間債券市場交易對手名單，並約定各交易對手所適用的交易結算方式。基金託管人監督基金管理人是否按事前提提供的銀行間債券市場交易對手名單進行交易。基金管理人可以每半年對銀行間債券市場交易對手名單進行更新，如基金管理人根據市場情況需要臨時調整銀行間債券市場交易對手名單，應向基金託管人說明理由，在與交易對手發生交易前3個工作日內與基金託管人協商解決。基金管理人收到基金託管人書面確認後，被確認調整的名單開始生效，新名單生效前已與本次剔除的交易對手所進行但尚未結算的交易，仍應按照協議進行結算。基金管理人負責對交易對手的信貸控制，按銀行間債券市場的交易規則進行交易，基金託管人則根據銀行間債券市場成交單對合同履行情況進行監督，但不承擔交易對手不履行合約造成的損失。如基金託管人事後發現基金管理人沒有按照事先約定的交易對手或交易方式進行交易時，基金託管人應及時提醒基金管理人，基金託管人不承擔由此造成的任何損失和責任。
- 5、基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金資產淨值計算、基金單位淨值計算、應收資金到賬、基金費用開支及收入確定、基金收益分配、相關信息披露、基金宣傳推介材料中登載基金業績表現數據等進行監督和核查。

如果基金管理人未經基金託管人的審核擅自將不實的業績表現數據印製在宣傳推介材料上，則基金託管人對此不承擔任何責任，並將在發現後立即報告中國證監會。

6、 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資流通受限證券進行監督。

- (1) 基金投資流通受限證券，應遵守《關於規範基金投資非公開發行證券行為的緊急通知》、《關於基金投資非公開發行股票等流通受限證券有關問題的通知》等有關法律法規規定。
- (2) 流通受限證券，包括由《上市公司證券發行管理辦法》規範的非公開發行股票、公開發行股票網下配售部分等在發行時明確一定期限鎖定期的可交易證券，不包括由於發佈重大消息或其他原因而臨時停牌的證券、已發行未上市證券、回購交易中的質押券等流通受限證券。
- (3) 在首次投資流通受限證券之前，基金管理人應當制定相關投資決策流程、風險控制制度、流動性風險控制預案等規章制度。基金管理人應當根據基金流動性的需要合理安排流通受限證券的投資比例，並在風險控制制度中明確具體比例，避免基金出現流動性風險。上述規章制度須經基金管理人董事會批准。上述規章制度經董事會通過之後，基金管理人應當將上述規章制度以及董事會批准上述規章制度的決議提交給基金託管人。
- (4) 在投資流通受限證券之前，基金管理人應至少提前一個交易日向基金託管人提供有關流通受限證券的相關信息，具體應當包括但不限於如下文件（如有）：
擬發行數量、定價依據、監管機構的批准證明文件複印件、基金管理人與承銷商簽訂的銷售協議複印件、繳款通知書、基金擬認購的數量、價格、總成本、劃款賬號、劃款金額、劃款時間文件等。基金管理人應保證上述信息的真實、完整。
- (5) 基金託管人在監督基金管理人投資流通受限證券的過程中，如認為因市場出現劇烈變化導致基金管理人的具體投資行為可能對基金資產造成較大風險，基金託管人有權要求基金管理人對該風險的消除或防範措施進

行補充和整改，並作出書面說明。否則，基金託管人經事先書面告知基金管理人，有權拒絕執行其有關指令。因拒絕執行該指令造成基金資產損失的，基金託管人不承擔任何責任，並有權報告中國證監會。

- (6) 基金管理人應保證基金投資的受限證券登記存管在本基金名下，並確保基金託管人能夠正常查詢。因基金管理人原因產生的受限證券登記存管問題，造成基金資產的損失或基金託管人無法安全保管基金資產的責任與損失，由基金管理人承擔。
 - (7) 如果基金管理人未按照本協議的約定向基金託管人報送相關數據或者報送了虛假的數據，導致基金託管人不能履行託管人職責的，基金管理人應依法承擔相應法律後果。除基金託管人未能依據基金合同及本協議履行職責外，因投資流通受限證券產生的損失，基金託管人按照本協議履行監督職責後不承擔上述損失。
- 7、 基金託管人發現基金管理人的上述事項及投資指令或實際投資運作中違反法律法規和基金合同的規定，應及時以書面形式通知基金管理人限期糾正。基金管理人應積極配合和協助基金託管人的監督和核查。基金管理人收到通知後應在下一工作日前及時核對並以書面形式給基金託管人發出回函，就基金託管人的疑義進行解釋或舉證，說明違規原因及糾正期限，並保證在規定期限內及時改正。在上述規定期限內，基金託管人有權隨時對通知事項進行複查，督促基金管理人改正。基金管理人對基金託管人通知的違規事項未能在限期內糾正的，基金託管人應報告中國證監會。基金託管人發現基金管理人依據交易程序已經生效的投資指令違反法律、行政法規和其他有關規定，或者違反基金合同約定的，應當立即通知基金管理人，並報告中國證監會。

- 8、 基金管理人**有義務配合和協助基金託管人**依照法律法規、基金合同和本託管協議對基金業務執行**核查**。對基金託管人發出的書面提示，基金管理人應在規定時間內答覆並改正，或就基金託管人的疑義進行解釋或舉證；對基金託管人按照法規要求需向中國證監會報送基金監督報告的事項，基金管理人應積極配合提供相關數據資料和制度等。
- 9、 基金託管人發現基金管理人有**重大違規行為**，應及時報告中國證監會，同時通知基金管理人限期糾正，並將糾正結果報告中國證監會。基金管理人無正當理由，拒絕、阻撓對方根據本協議規定行使監督權，或採取拖延、欺詐等手段妨礙對方進行有效監督，情節嚴重或經基金託管人提出警告仍不改正的，基金託管人應報告中國證監會。

(三) 基金管理人對基金託管人的業務核查

- 1、 基金管理人對基金託管人履行託管職責情況進行**核查**，核查事項包括基金託管人安全保管基金資產、開設基金資產的資金賬戶和證券賬戶、覆核基金管理人計算的基金資產淨值和基金單位淨值、根據基金管理人指令辦理清算交收、相關信息披露和監督基金投資運作等行為。
- 2、 基金管理人發現基金託管人擅自挪用基金資產、未對基金資產實行分賬管理、未執行或無故延遲執行基金管理人資金劃撥指令、泄露基金投資信息等違反《基金法》、基金合同、本協議及其他有關規定時，應及時以書面形式通知基金託管人限期糾正。基金託管人收到通知後應在下一工作日前及時核對並以書面形式給基金管理人發出回函，說明違規原因及糾正期限，並保證在規定期限內及時改正。在上述規定期限內，基金管理人有權隨時對通知事項進行複查，督促基金託管人改正。基金託管人應積極配合基金管理人的**核查行為**，包括但不限於：提交相關資料以供基金管理人核查託管財產的完整性和真實性，在規定時間內答覆基金管理人並改正。

- 3、 基金管理人發現基金託管人有重大違規行為，應及時報告中國證監會，同時通知基金託管人限期糾正，並將糾正結果報告中國證監會。基金託管人無正當理由，拒絕、阻撓對方根據本協議規定行使監督權，或採取拖延、欺詐等手段妨礙對方進行有效監督，情節嚴重或經基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人應報告中國證監會。

(四) 基金資產的保管

1、 基金資產保管的原則

- (1) 基金資產應獨立於基金管理人、基金託管人的固有財產。
- (2) 基金託管人應安全保管基金資產。未經基金管理人依據合法程序作出的合法合規指令，基金託管人不得自行運用、處分、分配基金的任何資產。
- (3) 基金託管人按照規定開設基金資產的資金賬戶和證券賬戶。
- (4) 基金託管人對所託管的不同基金資產分別設置賬戶，確保基金資產的完整與獨立。
- (5) 基金託管人根據基金管理人的指令，按照基金合同和本協議的約定保管基金資產，如有特殊情況雙方可另行協商解決。
- (6) 對於因為基金投資產生的應收資產，應由基金管理人負責與有關當事人確定到賬日期並通知基金託管人，到賬日基金資產沒有到達基金賬戶的，基金託管人應及時通知基金管理人採取措施進行催收。由此給基金資產造成損失的，基金託管人對此不承擔任何責任。
- (7) 除依據法律法規和基金合同的規定外，基金託管人不得委託第三人託管基金資產。

2、 基金募集期間及募集資金的驗資

- (1) 基金募集期間的資金應存於基金管理人在具有託管資格的商業銀行開設的基金認購專戶。該賬戶由基金管理人開立並管理。
- (2) 基金募集期滿或基金停止募集時，募集的基金單位總額、基金募集金額、基金單位持有人人數符合《基金法》、《運作辦法》等有關規定後，基金管理人應將屬基金資產的全部資金劃入基金託管人開立的基金銀行賬戶，同時在規定時間內，聘請具有從事證券、期貨相關業務資格的會計師事務所進行驗資，作出驗資報告。作出的驗資報告由參加驗資的2名或2名以上中國註冊會計師簽字方為有效。
- (3) 若基金募集期限屆滿，未能達到基金合同生效的條件，由基金管理人按規定辦理退款等事宜，基金託管人應提供充分協助。

3、 基金資金賬戶的開立和管理

- (1) 基金託管人應負責本基金的資金賬戶的開設和管理。
- (2) 基金託管人可以本基金的名義在其營業機構開設本基金的資金賬戶，並根據基金管理人合法合規的指令辦理資金收付。本基金的銀行預留印鑒由基金託管人保管和使用。本基金的一切貨幣收支活動，包括但不限於投資、支付贖回金額、支付基金收益、收取申購款，均需通過本基金的資金賬戶進行。
- (3) 基金資金賬戶的開立和使用，限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得假借本基金的名義開立任何其他銀行賬戶；亦不得使用基金的任何賬戶進行本基金業務以外的活動。
- (4) 基金資金賬戶的開立和管理應符合相關法律法規的有關規定。
- (5) 在符合法律法規規定的條件下，基金託管人可以通過基金託管人專用賬戶辦理基金資產的支付。

4、 基金證券賬戶的開立和管理

- (1) 基金託管人在中國證券登記結算有限責任公司上海分公司、深圳分公司為基金開立基金託管人與基金聯名的證券賬戶。
- (2) 基金證券賬戶的開立和使用，限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得出借或未經對方同意擅自轉讓基金的任何證券賬戶，亦不得使用基金的任何賬戶進行本基金業務以外的活動。
- (3) 基金託管人以自身法人名義在中國證券登記結算有限責任公司開立結算備付金賬戶，並代表所託管的基金完成與中國證券登記結算有限責任公司的一級法人清算工作，基金管理人應予以積極協助。結算備付金的收取按照中國證券登記結算有限責任公司的規定執行。
- (4) 基金證券賬戶的開立和證券賬戶卡的保管由基金託管人負責，賬戶資產的管理和運用由基金管理人負責。
- (5) 在本託管協議生效日之後，本基金被允許從事其他投資品種的投資業務，涉及相關賬戶的開設、使用的，按有關規定開設、使用並管理；若無相關規定，則基金託管人應當比照並遵守上述關於賬戶開設、使用的規定。

5、 債券託管專戶的開設和管理

基金合同生效後，基金託管人根據中國人民銀行、中央國債登記結算有限責任公司的有關規定，在中央國債登記結算有限責任公司開立債券託管與結算賬戶，並代表基金進行銀行間市場債券的結算。基金管理人和基金託管人同時代表基金簽訂全國銀行間債券市場債券回購主協議。

6、 其他賬戶的開立和管理

- (1) 因業務發展需要而開立的其他賬戶，可以根據法律法規和基金合同的規定，在基金管理人和基金託管人商議後由基金託管人負責開立。新賬戶按有關規則使用並管理。
- (2) 法律法規等有關規定對相關賬戶的開立和管理另有規定的，從其規定辦理。

7、 基金資產投資的有關有價憑證等的保管

基金資產投資的有關實物證券、銀行定期存款存單等有價憑證由基金託管人負責妥善保管，保管憑證由基金託管人持有。實物證券的購買和轉讓，由基金託管人根據基金管理人的指令辦理。屬基金託管人實際有效控制下的實物證券在基金託管人保管期間的損壞、丟失，由此產生的責任應由基金託管人承擔。託管人對託管人以外機構實際有效控制的證券不承擔保管責任。

8、 與基金資產有關的重大合同的保管

由基金管理人代表基金簽署的、與基金有關的重大合同的正本分別由基金管理人、基金託管人保管。除協議另有規定外，基金管理人在代表基金簽署與基金有關的重大合同時應保證基金一方持有兩份以上的正本，以便基金管理人和基金託管人至少各持有一份正本的副本。重大合同的保管期限為基金合同終止後15年。

(五) 基金收益與基金資產淨值的計算與覆核

1、 基金資產淨值

基金資產淨值是指基金資產總值減去負債後的金額。兩類基金單位淨值是指計算日該類基金資產淨值除以計算日該類基金單位總數後的金額。

基金單位淨值是指基金資產淨值除以基金單位總數。基金單位淨值的計算，精確到0.001元，小數點後第四位四捨五入，由此產生的誤差計入基金資產。國家另有規定的，從其規定。

本基金A類基金單位和H類基金單位分別設置代碼，並分別計算基金單位淨值。

2、 覆核程序

基金管理人每工作日對基金資產進行估值後，將基金單位淨值結果發送基金託管人，經基金託管人覆核無誤後，由基金管理人對外公佈。

(六) 基金單位持有人名冊的登記與保管

本基金的基金管理人和基金託管人須分別妥善保管的基金單位持有人名冊，包括基金合同生效日、基金合同終止日、基金權益登記日、基金單位持有人大會權益登記日、每年6月30日、12月31日的基金單位持有人名冊。基金單位持有人名冊的內容至少應包括持有人的名稱和持有的基金單位。

基金單位持有人名冊由註冊登記機構編製，由基金管理人審核並提交基金託管人保管。基金託管人有權要求基金管理人提供任意一個交易日或全部交易日的基金單位持有人名冊，基金管理人應及時提供，不得拖延或拒絕提供。

基金管理人應及時向基金託管人提交基金單位持有人名冊。每年6月30日和12月31日的基金單位持有人名冊應於下月前十個工作日內提交；基金合同生效日、基金合同終止日等涉及到基金重要事項日期的基金單位持有人名冊應於發生日後十個工作日內提交。

基金管理人和基金託管人應妥善保管基金單位持有人名冊，保存期限為15年。基金託管人不得將所保管的基金單位持有人名冊用於基金託管業務以外的其他用途，並應遵守保密義務。若基金管理人或基金託管人由於自身原因無法妥善保管基金單位持有人名冊，應按有關法規規定各自承擔相應的責任。

(七) 爭議解決方式和適用法律

因本協議產生或與之相關的爭議，雙方當事人應通過協商、調解解決，協商、調解不能解決的，任何一方均有權將爭議提交中國國際經濟貿易仲裁委員會，仲裁地點為北京市，按照中國國際經濟貿易仲裁委員會屆時有效的仲裁規則進行仲裁。仲裁裁決是終局的，對當事人均有約束力。

爭議處理期間，雙方當事人應恪守基金管理人和基金託管人職責，各自繼續忠實、勤勉、盡責地履行基金合同和本託管協議規定的義務，維護基金單位持有人的合法權益。

本協議適用中華人民共和國法律並從其解釋。

(八) 託管協議的修改與終止

1、 託管協議的變更程序

本協議雙方當事人經協商一致，可以對協議進行修改。修改後的新協議，其內容不得與基金合同的規定有任何衝突。基金託管協議的變更報中國證監會核准後生效。

2、 基金託管協議終止的情形

- (1) 基金合同終止；
- (2) 基金託管人解散、依法被撤銷、破產或由其他基金託管人接管基金資產；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤銷、破產或由其他基金管理人接管基金管理權；
- (4) 發生法律法規或基金合同規定的終止事項。

二十、對基金單位持有人的服務

基金管理人承諾為基金單位持有人提供一系列的服務。基金管理人將根據基金單位持有人的需要和市場的變化，增加或變更服務項目。主要服務內容如下：

(一) 資料寄送

1、 基金投資者對賬單：

基金管理人將向發生交易的基金單位持有人以書面或電子文件形式定期或不定期寄送對賬單。

2、 其他相關的信息資料。

(二) 多種收費方式選擇

基金管理人在合適時機將為基金投資者提供多種收費方式購買本基金，滿足基金投資者多樣化的投資需求，具體實施辦法見有關公告。

(三) 基金電子交易服務

基金管理人為基金投資者提供基金電子交易服務。投資人可登錄基金管理人的網站(www.cifm.com)查詢詳情。

(四) 聯絡方式

上投摩根基金管理有限公司

諮詢電話：488 889 4888

網址：www.cifm.com

二十一、其他應披露的事項

- 1、 2019年12月27日，上投摩根基金管理有限公司關於修改上投摩根新興動力混合型證券投資基金基金合同的公告。

上述公告均依法通過中國證監會指定的媒介予以披露。

二十二、招募說明書的存放及查閱方式

本招募說明書存放在基金管理人和基金代銷機構的辦公場所和營業場所，基金投資者可免費查閱。在支付手續費後，可在合理時間內取得上述文件的複製件或複印件。

二十三、備查文件

- (一) 中國證監會批准上投摩根新興動力混合型證券投資基金募集的文件
- (二) 上投摩根新興動力混合型證券投資基金基金合同
- (三) 上投摩根新興動力混合型證券投資基金託管協議
- (四) 法律意見書
- (五) 基金管理人業務資格批件、營業執照
- (六) 基金託管人業務資格批件、營業執照
- (七) 上投摩根基金管理有限公司開放式基金業務規則
- (八) 中國證監會要求的其他文件

上述備查文件存放在基金管理人和基金代銷機構的辦公場所和營業場所，基金投資者可免費查閱。在支付手續費後，可在合理時間內取得上述文件的複製件或複印件。

www.jpmorganam.com.hk