

汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数  
证券投资基金更新招募说明书  
(2017 年第 1 号)

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

**【重要提示】**

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2011年11月17日证监许可[2011]1833号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，某一基金的特定风险等。本基金属于股票型指数基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。投资有风险，投资人认购（申购）本基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2017年2月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年12月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人 .....	9
四、基金托管人 .....	19
五、相关服务机构 .....	23
六、基金的募集 .....	42
七、基金合同的生效 .....	46
八、基金份额的申购与赎回.....	48
九、基金的转换 .....	58
十、定期定额投资计划.....	59
十一、基金的投资 .....	60
十二、基金的业绩 .....	70
十三、基金的财产 .....	73
十四、基金资产的估值.....	75
十五、基金的收益与分配.....	80
十六、基金的费用与税收.....	82
十七、基金的会计和审计.....	85
十八、基金的信息披露.....	86
十九、风险揭示 .....	91
二十、基金的变更、终止与清算.....	94
二十一、基金合同的内容摘要.....	97
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	113
二十三、对基金份额持有人的服务.....	133
二十四、其他应披露事项.....	135
二十五、招募说明书的存放及查阅方式.....	136
二十六、备查文件 .....	137

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指汇丰晋信基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国邮政储蓄银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

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

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

22、直销机构：指汇丰晋信基金管理有限公司

23、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、销售机构：指直销机构和代销机构

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

26、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为汇丰晋信基金管理有限公司或接受汇丰晋信基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

27、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

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

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

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、《业务规则》：指《汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，投资人按基金合同和招募说明书申请购买基金份额的行为

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

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

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由该销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行

账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%

45、元：指人民币元

46、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

47、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额所得数值

50、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

51、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

52、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

53、不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件

54、A 类基金份额：指在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用的基金份额

55、C 类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

法定代表人：杨小勇

设立日期：2005 年 11 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】172 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：周慧

联系电话：021-20376868

股权结构：山西信托股份有限公司（以下简称“山西信托”）持有 51%的股权，HSBC Global Asset Management (UK) Limited（汇丰环球投资管理（英国）有限公司）持有 49%的股权。

#### （二）主要人员情况

##### 1. 董事会成员

杨小勇先生，董事长，硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资（集团）公司副总经理，山西光信实业有限公司副董事长，山西省国信投资（集团）公司党委书记、山西信托副董事长，晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长（正职待遇）。现任山西金融投资控股集团有限公司专职党委副书记、副总经理（正职待遇）。

郭晋普先生，董事，硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理，太原万丰房地产发展有限公司总经理，山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长，山西信托董事长。现任山西国信投资集团有限公司专职党委副书记、副总经理。

柴宏杰先生，董事，本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任，晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长，山西省国信投资（集团）公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛资本管理有限公司董事、董事长，山西国信投资集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。现任山西金融投资控股集团有限公司投资总监兼投资管理部总经理。

李选进先生，董事，硕士学历。曾任怡富基金有限公司电子商务及项目发展部经理、业务拓展总监，汇丰投资管理（香港）董事兼亚太区企业拓展及中国事业主管，汇丰晋信基金管理有限公司总经理、董事。现任汇丰中华证券投资信托股份有限公司董事长。

巴培卓（Pedro Augusto Botelho Bastos）先生，董事。曾任汇丰环球投资管理（巴西）行政总裁、汇丰环球投资管理（拉丁美洲）首席投资官、行政总裁。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。

王栋先生，董事。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师（CFA）。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生，独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长，国家发改委经济研究所常务副所长、教授、博士研究生导师。现任清华大学中国经济研究中心研究员。

梅建平先生，独立董事，博士学历。曾任纽约大学金融学副教授、芝加哥大学访问副教授、阿姆斯特丹大学访问副教授、清华大学特聘教授、长江商学院 EMBA 项目副院长。现任长江商学院金融学教授。

叶迪奇先生，独立董事，硕士学历。曾担任汇丰银行（美国）西岸业务副总裁，汇丰银行（香港）零售部主管、汇丰银行中国总代表处中国业务总裁、交通银行副行长、国际金融协会（IIF）亚太区首席代表。现任星展银行（香港）有限公司独立董事。

## 2. 监事会成员基本情况：

焦杨先生，监事，硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理，常务副总经理，山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理。现任山西

金融投资控股集团有限公司运营总监兼资本运营部总经理，山西证券股份有限公司监事会主席，山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

黄碧娟女士，监事，本科学历。曾任汇丰集团银团贷款经理、资本市场部高级经理、大中华地区债务发行部主管、环球银行部香港区常务总监、汇丰银行（中国）有限公司副行政总裁、行长兼行政总裁。现任香港上海汇丰银行有限公司大中华地区行政总裁。

曹菁女士，监事，硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理、汇丰晋信基金管理有限公司人事经理，现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生，监事，硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资（集团）公司担任交易员及投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员，现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

### 3. 总经理及其他高级管理人员基本情况：

王栋先生，总经理，硕士学历。中国注册会计师（CPA）和特许金融分析师（CFA）。曾任汇丰环球投资管理（英国）有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理（香港）有限公司亚太企业拓展经理，其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生，副总经理，本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

王立荣先生，副总经理，硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监；上海万方投资管理有限公司副总经理；汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士，副总经理，硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监；中银基金管理有限公司基金运营部总监；汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监；现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张毅杰先生，副总经理，硕士学历。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务部总监。

曹庆先生，副总经理，硕士学历。曾任东方基金管理有限公司研究员、法国

巴黎银行证券上海代表处研究员、汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员、投资部研究副总监、投资部研究总监。现同时担任汇丰晋信基金管理有限公司投资部总监、基金经理。

古韵女士，督察长，硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理，国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

#### 4. 本基金基金经理

方磊女士，华东师范大学数理统计系学士，新加坡南洋理工大学数学系硕士。方磊女士曾任职于新加坡辉立证券公司任金融工程师，在三年任职期间，其运用金融量化模型，为公司自营业务建立了多种投资套利模型以及各类标的指数的优化复制模型，包括股指期货与指数现货间、各类金融期货间（包括股票期货等）的套利模型，同时运用量化分析为公司做市商业业务建立了程序化自动做市交易模型，其在海外证券市场上的金融交易模型研究以及量化投资有丰富的实战经验。回国后，其分别任职于易评咨询有限公司顾问统计，以及德隆友联战略投资管理有限公司数据分析师等。参与易评咨询有限公司的中国基金评估业务体系筹建，依靠扎实的量化分析基础，负责公司对中国市场的基金绩效评估工作，并运用基金风险调整后收益、业绩持续性以及择时能力等量化指标在中国基金指数建立方面进行了大量的研究和量化分析工作；参与德隆友联战略投资管理有限公司对集团下属分支机构的风险管理，运用数学模型理论，建立包括信用风险评估、流动性风险管理、资产负债结构管理以及利率风险管理等量化风险管理。

方磊女士于 2006 年加入汇丰晋信基金管理有限公司，曾任公司风险管理部副总监，协助管理层运用量化分析理论对各类投资组合进行业绩和风险绩效评估，并使用流动性风险、跟踪误差和投资组合周转率等辅助风险控制指标对基金投资风险定期进行动态风险管理。方磊女士不仅在风险量化分析和研究方面有扎实的理论功底，而且在运用量化分析工具进行证券投资的长期实践中，也积累了丰富的实战经验。

#### 5. 投资委员会成员的姓名和职务

王栋，总经理；曹庆，副总经理、投资部总监兼汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金和汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金基金经理；郑宇尘，固定收益部总监；丘栋荣，股票投资部总监兼汇丰晋

信大盘股票型证券投资基金和汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金基金经理；郭敏，研究部总监兼汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金基金经理。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的职责为：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分

配收益；

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

17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

1. 基金管理人将严格遵守法律法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》及其他法律法规的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）用基金财产承销证券；

- (6) 用基金财产向他人贷款或提供担保;
  - (7) 用基金财产从事无限责任的投资;
  - (8) 用基金财产买卖其他基金份额, 但国务院另有规定的除外;
  - (9) 以基金财产向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
  - (10) 以基金财产买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
  - (11) 用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
  - (12) 基金财产参与股票发行申购, 所申报的金额超过基金的总财产, 基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
  - (13) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定;
  - (14) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。
3. 基金管理人承诺加强人员管理, 强化职业操守, 督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范, 诚实信用、勤勉尽责, 不从事以下活动:
- (1) 越权或违规经营;
  - (2) 违反基金合同或托管协议;
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
  - (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
  - (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
  - (6) 玩忽职守、滥用职权;
  - (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
  - (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外, 直接或间接进行其他股票投资; 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
  - (9) 违反证券交易场所业务规则, 利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;
  - (10) 贬损同行, 以提高自己;
  - (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 4. 基金经理承诺

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

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

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1. 内部控制的目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

##### 2. 内部控制的原则

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

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

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

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

##### 3. 内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。公



司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

#### 4. 内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，各个业务部门负责本部门的内部控制，督察长和监察稽核部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

##### (1) 董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

##### (2) 督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

##### (3) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。监察稽核部对总经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议。

#### (4) 业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

#### 5. 基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一)基金托管人情况

#### 1. 基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：686.04亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010—68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现

股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

## 2. 主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

## 3. 托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2016年6月30日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共48只，包括中欧行业成长混合型证券投资基金 (LOF) (原中欧中小盘股票型证券投资基金 (LOF)) (166006)、长信纯债壹号债券型证券投资基金 (原长信中短债证券投资基金) (519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金 (400013)、万家添利债券型证券投资基金 (LOF) (161908)、长信利鑫分级债券型证券投资基金 (163003)、天弘丰利债券型证券投资基金 (LOF) (164208)、鹏华丰泽债券型证券投资基金 (LOF) (160618)、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 (400015)、长安宏观策略股票型证券投资基金 (740001)、金鹰持久增利债券型证券投资基金 (LOF) (162105)、中欧信用增利债券型证券投资基金 (LOF) (166012)、农银汇理消费主题股票型证券投资基金 (660012)、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金 (519117)、天弘现金管家货币市场基金 (420006)、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金 (540012)、华安安心收益债券型证券投资基金 (040036)、东方强化收益债券型证券投资基金 (400016)、中欧纯债分级债券型证券投资基金 (166016)、东方安心收益保本混合型证券投资基金 (400020)、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金 (519662)、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金 (166021)、银河灵活配置混合型证券投资基金 (519656)、天弘通利混合型证券投资基金 (000573)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金 (000552)、南

方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金（000774）、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金（000966）、中信建投凤凰货币市场基金（001006）、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（001194）、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金（001183）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金（001216）、易方达改革红利混合型证券投资基金（001076）、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金（001250）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（001249）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金（001285）、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金（001210）、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金（001447）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（001314）、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金（001431）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金（001433）、南方利安灵活配置混合型证券投资基金（001570）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金（002107）、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金（002388）、博时泰和债券型证券投资基金（002608）、融通增益债券型证券投资基金（002342）、东兴安盈宝货币市场基金（002759）。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达32,857.61亿元。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2. 内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制组，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

### 3. 内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2. 监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### （1）直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

电话：021-20376868

传真：021-20376989

联系人：王晶晶

客户服务中心电话：021-20376888

公司网址：[www.hsbcjt.cn](http://www.hsbcjt.cn)

汇丰晋信基金电子交易平台

网址：<https://etrading.hsbcjt.cn/>

联系人：王晶晶

电话：021-20376957

#### （2）代销机构

1) 汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金 A 类基金份额代销机构：

##### ■ 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

传真：（010）68858117

公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

##### ■ 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：张宏革

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

■ 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

■ 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：021-66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

■ 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

■ 招商银行股份有限公司



住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：刘薇

客户服务热线：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

■ 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：汤嘉惠、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

■ 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

■ 温州银行股份有限公司

住所、办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：（0577）88990082

传真：（0577）88995217

客服电话：（0577）96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

■ 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务热线：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

■ 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联络人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：95541

公司网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

■ 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999

公司网址：<http://www.srcb.com>

■ 洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛南新区开元大道 256 号洛阳银行大厦

法定代表人：王建甫

客服电话：96699

网址：<http://www.bankofluoyang.com.cn>

■ 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

■ 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

■ 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城东路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

传真：021-38670161

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

■ 申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

■ 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：(010)66568116

客服电话：400-8888-888

网址：www.chinastock.com.cn

■ 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点电话

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

■ 华泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：樊昊

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

■ 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

联系人：杨盛芳

电话：0591-87613888

传真：0591-87546058

客户服务电话：400-8888-123

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

■ 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

■ 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

客服电话：010-84588888

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

■ 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、10108998

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

■ 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇 陈曦

客服电话：400 910 1166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

■ 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：010-66045529

传真：010-660455 18

客服电话：010-66045678

天相投顾网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

■ 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山北路 318 号 2 号楼 21-29 楼

办公地址：上海市中山北路 318 号 2 号楼 21-29 楼

法定代表人：潘鑫军

联络人：吴宇、沈燕

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客服电话：95503

公司网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

■ 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

客户服务电话：95310

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

■ 国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：0551-2207938

传真：0551-2207965

客服电话：4008-888-777、95578

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

■ 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河区大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

■ 中信建投证券股份有限公司

注册地址：朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108(免长途费)

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)



■ 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服电话：4008001001

公司网址：[www.essences.com.cn](http://www.essences.com.cn)

■ 中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

■ 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636 客服电话：400-8888-111、95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

■ 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地点：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

■ 上海天天基金销售有限公司

注册地点：上海浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

■ 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地点：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周瑾旻

客户服务电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

■ 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地点：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

公司网站：[www.10jqka.com.cn](http://www.10jqka.com.cn)

客服电话：95105-885 0571-56768888

■ 上海好买基金销售有限公司

注册地点：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：薛年

客户服务电话：400-700-9665

网址：ww.ehowbuy.com

■ 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地点：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

联系人：姚思轶

公司网站：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

■ 东海证券有限责任公司

注册地点：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：汪汇

公司网站：www.longone.com.cn

客服电话：400-8888-588

■ 中泰证券股份有限公司

注册地点：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889518

公司网站：www.zts.com.cn

■ 浙商证券股份有限公司

注册地点：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

法定代表人：吴承根

联系人：许嘉行

公司网站：www.stocke.com.cn

客服电话：（浙江省内）967777

■ 华鑫证券有限责任公司

注册地点：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

法定代表人：洪家新

联系人：陈敏

公司网站：www.cfsc.com.cn

客服电话：021-32109999；029-68918888

■ 信达证券股份有限公司

注册地点：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

公司网址：www.cindasc.com

客服电话：400-800-8899

■ 和讯信息科技有限公司

注册地点：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：周轶

公司网站：licaike.hexun.com

客服电话：4009-200-022

■ 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地点：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公区地址为：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

公司网站: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

客服电话: 400-888-6661

■ 华安证券股份有限公司

注册地点: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 李工

公司网站: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

客服电话: 400-809-6518

■ 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 杨泽柱

电话: 021-68751929

联系人: 李良

客户服务电话: 95579

网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

■ 东兴证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人: 魏庆华

联系人: 汤漫川

电话: 010-66555316

传真: 010-66555147

客户服务电话: 4008888993

网址: [www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

■ 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：唐岚

电话：010-88085258

传真：010-88013605

■ 中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

客服电话：400-990-8826

公司网站：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

■ 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

公司网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客服电话：400 893 6885

■ 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：鲍东华

公司网站：www.lufunds.com

客服电话：4008219031

2) 汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金 C 类基金份额代销机构：

■ 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：张宏革

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

■ 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联络人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客服电话：95541

公司网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

■ 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999

公司网址：<http://www.srcb.com>

■ 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

(二) 注册登记机构

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

法定代表人：杨小勇

联系人：赵琳

联系电话：021-20376892

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红 黎明

(五) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)



住所：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人/首席合伙人：杨绍信

联系电话：021-2323 8888

传真电话：021-2323 8800

经办注册会计师：薛竞、赵钰

联系人：赵钰

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并于 2011 年 11 月 17 日经中国证监会证监许可[2011]1833 号文核准募集。

### （二）基金存续期间

不定期

### （三）基金类型

股票型证券投资基金

### （四）募集方式

通过基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告)公开发售。

### （五）募集期限

本基金于 2012 年 5 月 8 日起通过各销售机构向社会公开募集，截至 2012 年 7 月 27 日，本基金募集工作已顺利结束。

### （六）募集对象

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

### （七）基金份额的类别

本基金根据认购/申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

### （八）募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售，详情见基金份额发售公告。

### （九）基金的最高募集规模

本基金不设募集上限。

### （十）基金份额面值、认购价格及计算公式、认购费用

（1）基金份额初始面值：1.00 元人民币

（2）基金份额认购价格：1.00 元人民币

（3）认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，收费方式为前端收费，认购费率具体如下：

认购金额（万元）	前端认购费率
A < 50	1.0%
50 ≤ A < 100	0.6%
100 ≤ A < 500	0.3%
A ≥ 500	每笔 1000 元

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

### （4）认购份额的计算

投资者在认购本基金时缴纳认购费用，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 前端认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) / 基金份额初始面值

对于适用固定金额认购费的认购：净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

上述认购费用、认购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：假定 T 日的基金份额净值为 1.0 元，申购金额为 1 万元，认购费率为 1.0%，则需负担的认购费用和得到的基金份额为：

净认购金额 = 10000 / (1 + 1.0%) = 9900.99 元

认购手续费=10000-9900.99=99.0099 元

认购份额=9900.99/1.0=9900.99 份

即：投资人投资 1 万元认购本基金，可得到 9900.99 份基金份额。

#### （十一）投资人对基金份额的认购

##### （1）认购时间安排

本基金募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月，暂定募集期从 2012 年 5 月 8 日起至 2012 年 6 月 8 日。具体认购时间安排请见本基金基金份额发售公告。

##### （2）投资人认购应提交的文件和办理的手续

基金投资人可在募集期间到基金销售网点认购本基金，按照销售机构的规定办理基金认购手续，填写认购申请书，并足额缴纳认购款（具体请参见基金份额发售公告）。首次认购之前必须持有效证件开立汇丰晋信基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户。

##### （3）认购的方式及确认

投资人在募集期内可多次认购基金份额，认购申请一经受理，不得撤销。

投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请，可于 T+2 日后在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购申请是否被成功受理。

投资人可于基金合同生效后在原申请网点或通过基金管理人的客户服务中心查询认购确认份额。

##### （4）认购限额

在本基金募集期内，投资人首次单笔认购的最低金额为 1,000 元，追加认购的最低金额 1,000 元。

#### （十二）募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，其中基金募集期产生的利息的具体金额及利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（十三）基金募集行为结束前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。

本次募集有效认购总户数为 1,232 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，

募集发售期募集的有效份额为 263,691,636.68 份，利息结转的基金份额为 36,396.94 份基金份额，两项合计共 263,728,033.62 份基金份额，已全部计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

1. 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，且基金募集达到基金备案条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2. 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3. 基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息折算基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （二）基金募集失败的处理方式

1. 基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。

2. 如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

3. 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

(四) 本基金基金合同已于 2012 年 8 月 1 日生效。

## 八、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过直销机构和代销机构进行。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。销售机构名单和联系方式见上述第五部分第（一）条或基金份额发售公告和其他相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### (二) 申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日，具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2012 年 8 月 31 日起开始办理日常申购业务。

本基金已于 2012 年 8 月 31 日起开始办理日常赎回业务。

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

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

### (三) 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净



值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式及时查询申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购或赎回申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，注册登记机构可根据《业务规则》，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在基金管理人和代销机构规定的时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其他相关代销机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人的银行账户。如遇证

券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款在该等故障消除后及时划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### （五）申购和赎回的数额和价格

##### 申购金额、赎回份额及余额的处理方式

1. 投资人首次申购 A 类基金份额的单笔最低金额 1,000 元（已认购本基金基金份额的不受首次申购最低金额限制），追加申购每次最低金额 1,000 元；投资人首次申购 C 类基金份额的单笔最低金额为 1,000 元，追加申购每次最低金额 1,000 元。各代销机构对最低申购限额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2. 对于 A 类或 C 类基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 500 份基金份额；每个交易账户的最低基金份额余额不得低于 500 份，基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 500 份的，需一次全部赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 500 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见定期更新的招募说明书。

4. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购与赎回的费用

##### 1. 申购费率：

本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类基金份额以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用，收费方式为前端收费，申购费率具体如下：

申购金额（万元）	前端申购费率
A < 50	1.2%
50 ≤ A < 100	0.8%

$100 \leq A < 500$	0.4%
$A \geq 500$	每笔 1000 元

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

## 2. 赎回费率

(1) 本基金 A 类份额的赎回费率如下：

持有时间 (N)	赎回费率
$N < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$	0.25%
$N \geq 2$ 年	0

注：1 个月为 30 天，1 年为 365 天，N 为持有期限。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2) 本基金 C 类份额的赎回费率如下：

持有时间 (N)	赎回费率
$N < 30$ 天	0.5%
$30 \text{ 天} \leq N < 6 \text{ 个月}$	0.20%
$N \geq 6$ 个月	0

注：1 个月为 30 天，1 年为 365 天，N 为持有期限。

对于持续持有 C 类基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有 C 类基金份额长于 30 日但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按

相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

### （七）申购份额与赎回金额的计算

#### 1. 对于申购本基金 A 类份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额以申请当日 A 类基金份额净值为基准计算，计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

$$\text{对于适用固定金额申购费的申购：净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

以上申购费用、申购份额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：假定 T 日的基金份额净值为 1.1 元，申购本基金 A 类份额的金额为 1 万元，申购费率为 1.2%，

则需负担的申购费用和得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.2\%) = 9881.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 10000 - 9881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9881.42 / 1.1 = 8983.11 \text{ 份}$$

即：投资人投资 1 万元申购本基金 A 类份额，可得到 8983.11 份基金份额。

#### 2. 对于申购本基金 C 类份额的计算

$$\text{申购份额} = \text{申购基金} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

例：假定 T 日的基金份额净值为 1.040 元，申购本基金 C 类份额的金额为 1 万元，

则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{申购份额} = 10000 / 1.040 = 9,615.38 \text{ 份}$$

即：该投资人投资 1 万元申购本基金 C 类份额，可得到 9,615.38 份基金份额。

在 C 类基金份额存续期间，本基金从 C 类基金资产中计提销售服务费。

#### 3. 赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，以申请当日基金份额净值为基准计算，计算公式如下：

赎回总额=T 日基金份额净值×赎回份额

赎回费用=T 日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回金额=T 日基金份额净值×赎回份额-赎回费用

以上赎回费用、赎回金额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资人赎回 1 万份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.2=12000 元

赎回费用=12000×0.5%=60 元

赎回金额=12000-60=11940 元

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.2 元，则其可得到的赎回金额为 11940 元。

例：某投资人赎回 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 40 天，对应的赎回费率为 0.2%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.050=10,500 元

赎回费用=10500×0.20%=21.00 元

净赎回金额=10500-21=10,479.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 40 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.050 元，则其可得到的赎回金额为 10479.00 元。

#### 4. 基金份额净值的计算公式

由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。计算公式为：

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额的余额数量

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### （八）申购与赎回的注册登记

1. 经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人

规定的时间之前可以撤销。

2. 投资人申购基金成功后, 注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续, 投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3. 投资人赎回基金成功后, 注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4. 基金管理人可在法律法规允许的范围内, 对上述注册登记办理时间进行调整, 并最迟于开始实施 2 日前予以公告。

#### (九) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时, 基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。此时, 本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理:

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、证券交易所交易时间临时停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 6、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝, 被拒绝的申购款项将退还给投资人, 基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### (十) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。此时, 本基金的转出申请将按同样方式处理:

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付，但最长不超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### (十一)巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按基金份额持有人提交的每笔赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定该笔赎回申请当日部分确认的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；

选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

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

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、重新开放申购或赎回时，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### (十三) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十四) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记



机构的规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

#### (十五) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### (十六) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### (十七) 基金份额的冻结和解冻

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

## 九、基金的转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其它开放式基金份额的行为。基金管理人在本基金合同生效后适当时候将为投资者办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率届时在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天至少在一种中国证监会指定媒体上刊登公告并按有关规定报中国证监会备案。

基金管理人已于 2012 年 8 月 31 日开通本基金的转换业务。

## 十、定期定额投资计划

定期定额投资计划,是指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

在各项条件成熟的情况下,本基金可为投资者提供定期定额投资计划服务,具体实施方法以招募说明书或基金管理人届时公布的业务规则为准。

基金管理人已于2012年8月31日起正式推出本基金的定期定额投资计划。

## 十一、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金主要采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对标的有效跟踪。

### (二) 投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后，本基金在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

### (三) 标的指数

本基金选择恒生 A 股行业龙头指数作为跟踪标的指数。

恒生 A 股行业龙头指数由恒生指数有限公司编制并发布。该指数对沪深两市所有 A 股（创业板、ST/\*ST 或 S 股除外）进行流动性检测，形成指数的备选成份股（共 300 只股票）。随后将备选成份股按照恒生行业分类划分为 11 种恒生一级行业，并将成份股依据过去一年公司平均总市值、过去两年平均净盈利、过去两年平均收入在各自一级行业分别排名，将上述指标排名赋予 50%、30%、20% 的权重后相加，所得和的排名作为股票的综合排名。该指数选择各行业综合排名前 5 位的股票进入最终的成份股。因此，该指数网罗了沪深两市在恒生行业分类系统内 11 种行业类别中每一种行业的领导者，反映了中国 A 股行业领导者的整体表现。

如果恒生指数公司停止恒生 A 股行业龙头指数的编制及发布、或恒生 A 股行业龙头指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更，导致恒生 A 股行业龙头指数不宜继续作为本基金标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与托管人协商一致并履行相关程序后，变更本基金的标的指数，相应更换基金名

称和业绩比较基准，应报中国证监会备案并及时公告。

#### (四) 投资策略

本基金为被动式指数基金，采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等公司事件时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

#### 1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法来跟踪恒生 A 股行业龙头指数，即按照恒生 A 股行业龙头指数成份股组成及权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现，减小跟踪误差，基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整：

(1) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案，并判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。

(2) 基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

(3) 指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等公司事件时，基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。

(4) 当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当替代。本基金选择恒生 A 股行业龙头指数成份股或备选成份股构建替代成份股。

#### 2、债券投资策略：

本基金可以投资于剩余期限在一年以内的政府债券和回购，其主要的作用为现金的替代资产，其投资的目的是在实现资产更高的流动性而非收益性。基金管理人将优先选择流动性较好的政府债券进行投资，并通过对基金现金需求的科学分析，合理分配基金资产在债券上的配置比例。

#### (五) 业绩比较基准

业绩比较基准 = 恒生 A 股行业龙头指数\*95%+银行活期存款收益率(税后)\*5%

恒生 A 股行业龙头指数由恒生指数有限公司编制并发布。该指数网罗了沪深两市在恒生行业分类系统内 11 种行业类别中每一种行业的领导者，反映了中国 A 股行业领导者的整体表现。

如果上述基准指数停止计算编制，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩评价基准，应报中国证监会备案并及时公告。

#### (六) 风险收益特征

本基金属于股票型指数基金，属证券投资基金中的高风险、高收益品种，其长期平均风险和收益预期高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。

#### (七) 投资限制

##### 1、组合限制

(1) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(2) 本基金持有的现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(3) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的同一资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(4) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(6) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对基金合同约定的投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金不受上述限制。以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动；

如法律法规或监管部门取消上述限制，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

#### (十) 指数公司的免责声明

[恒生指数]（「该（等）指数」）乃由恒生指数有限公司根据恒生信息服务有限公司特许协议发布及编制。「恒生指数」之标记及名称由恒生信息服务有限公司拥有。恒生指数有限公司及恒生信息服务有限公司已同意（发行人）可就（产品名称）（「该产品」）使用及引述该（等）指数，惟恒生指数有限公司及恒生信息服务有限公司并无就（i）任何该（等）指数及其计算或任何其它与之有关的数据的准确性及完整性；或（ii）任何该（等）指数或其中任何成份或其所包涵的资料作任何用途之适用性或适合性；或（iii）任何人士因使用任何该（等）指数或其中任何成份或其所包涵的资料作任何用途而引致之结果，而向该产品之任何经纪或该产品持有人或任何其它人士作出保证或声明或担保，亦不会就任何该（等）指数提供或默示任何保证、声明或担保。恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该（等）指数及其任何有关程序、成份股份及系数之过程及基准，而无须作出通知。于法律容许的范围内，恒生指数有限公司或恒生信息服务有限公司不会因（i）（发行人）就该产品引用及/或参考任何该（等）指数；或（ii）恒生指数有限公司在计算任何该（等）指数时的任何失准、遗漏、失误或错误；或（iii）与计算任何该（等）指数有关并由任何其它人士提供的资料的任何失准、遗漏、失误、错误或不完整；或（iv）任何经纪、该产品持有人或任何其它处置该产品的人士，因上述原因而直接或间接蒙受的任何经济或其它损失承担任何责任。任何经纪、持有人或任何其它处置该产品的人士，不得因有关该产品，以任何形式向恒生指数有限公司及/或恒生信息服务有限公司进行索偿、法律行动或法律诉讼。任何经纪、持有人或任何其它处置该产品的人士，须完全了解此免责声明，并且不能依赖恒生指数有限公司及恒生信息服务有限公司。为免产生疑问，本免责声明并不会于任何经纪、持有人或任何其它人士与恒生指数有限公司及/或恒生信息服务有限公司之间构成任何合约或准合约关系，而亦不应视作已构成该等合



约关系。

#### （十一）基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人——中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资组合报告的报告期为 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告中的财务资料未经审计。

##### 11.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	59,334,878.72	93.80
	其中：股票	59,334,878.72	93.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,765,841.47	5.95
8	其他资产	154,020.15	0.24
9	合计	63,254,740.34	100.00

## 11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,258,011.74	8.36
C	制造业	20,331,784.75	32.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,085,744.14	6.50
E	建筑业	6,007,751.53	9.56
F	批发和零售业	1,262,032.55	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,294,874.34	5.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和技术服务业	1,475,720.87	2.35
J	金融业	14,246,606.21	22.66
K	房地产业	2,378,683.05	3.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	542,864.50	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	450,805.04	0.72

	合计	59,334,878.72	94.39
--	----	---------------	-------

### 11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601318	中国平安	173,000	6,129,390.00	9.75
2	600519	贵州茅台	11,931	3,986,743.65	6.34
3	601288	农业银行	1,050,260	3,255,806.00	5.18
4	601668	中国建筑	321,410	2,847,692.60	4.53
5	000333	美的集团	99,473	2,802,154.41	4.46
6	000651	格力电器	107,474	2,646,009.88	4.21
7	000002	万 科 A	115,751	2,378,683.05	3.78
8	601398	工商银行	513,637	2,265,139.17	3.60
9	601766	中国中车	191,012	1,866,187.24	2.97
10	600104	上汽集团	78,759	1,846,898.55	2.94

### 11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资 明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持 证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 11.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资 明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明 细

本基金本报告期末未持有权证。

### 11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 11.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 11.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 11.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 11.11 投资组合报告附注

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

11.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 11.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,976.51
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,147.46
5	应收申购款	141,896.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,020.15

#### 11.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### (一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

#### 1. 汇丰晋信恒生龙头指数 A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2012/8/1(基金合同生效日) -2012/12/31	4.28%	0.94%	5.62%	0.97%	-1.34%	-0.03%
2013/1/1-2013/12/31	-13.09%	1.08%	-14.37%	1.06%	1.28%	0.02%
2014/1/1-2014/12/31	48.18%	1.08%	47.39%	1.10%	0.79%	-0.02%
2015/1/1-2015/12/31	5.43%	2.42%	6.90%	2.34%	-1.47%	0.08%
2016/1/1-2016/12/31	-0.35%	1.34%	-1.92%	1.18%	1.57%	0.16%

#### 2. 汇丰晋信恒生龙头指数C

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2015/4/1-2015/12/31	-4.82%	2.56%	-4.76%	2.45%	-0.06%	0.11%
2016/1/1-2016/12/31	-0.91%	1.34%	-1.92%	1.18%	1.01%	0.16%

### (二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

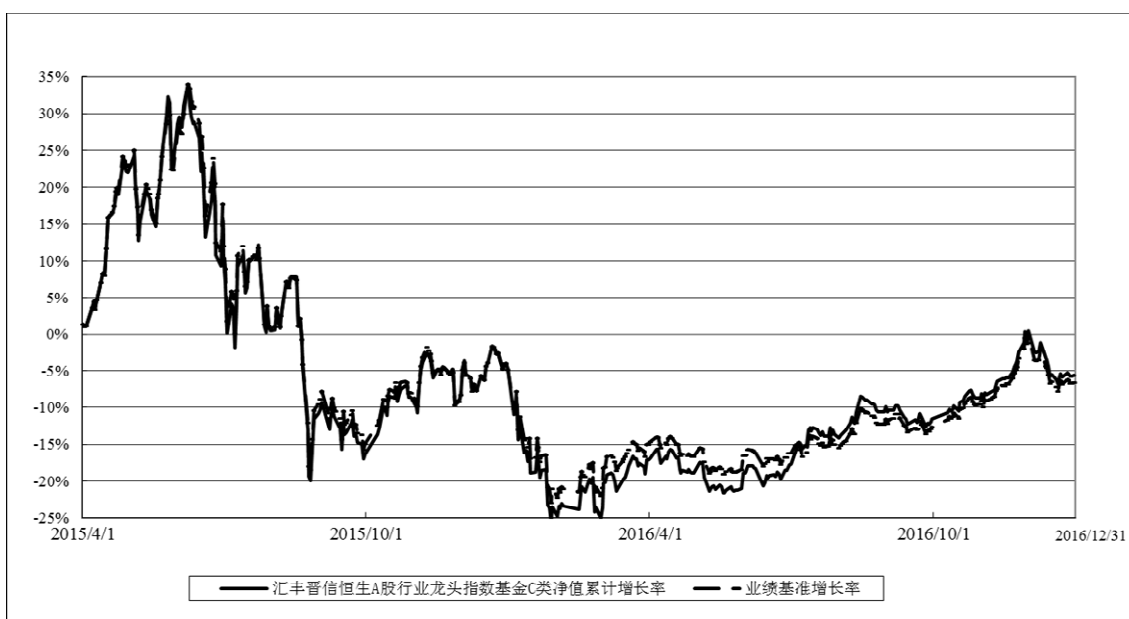
#### 1. 汇丰晋信恒生龙头指数 A



注：

1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓。截止 2012 年 10 月 31 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。
2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 恒生 A 股行业龙头指数\*95%+银行活期存款收益率(税后)\*5%。
3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含恒生 A 股行业龙头指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## 2. 汇丰晋信恒生龙头指数 C



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：投资于标的指数的成份股与备选成

份股的组合比例不低于基金资产净值的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过三个月内完成建仓。

2. 报告期内本基金的业绩比较基准 = 恒生 A 股行业龙头指数\*95%+银行活期存款收益率(税后)\*5%。

3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含恒生 A 股行业龙头指数成份股在报告期产生的股票红利收益。



### 十三、基金的财产

#### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

- (1) 银行存款及其应计利息；
- (2) 结算备付金及其应计利息；
- (3) 根据有关规定缴存的保证金及其应收利息；
- (4) 应收证券交易清算款；
- (5) 应收申购款；
- (6) 股票投资及其估值调整；
- (7) 债券投资及其估值调整和应计利息；
- (8) 其他投资及其估值调整；
- (9) 其他资产等。

#### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

#### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### (四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约

定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （二）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

估值；

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，A 类和 C 类基金份额净值均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应当每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将两类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无

误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当 A 类或 C 类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿。

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

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

##### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不

当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，从基金资产中支付。

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

(3) 因基金份额净值计算错误, 给基金或基金份额持有人造成损失的, 应当按照法律法规的规定向基金或基金份额持有人进行赔偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差, 以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。如果行业有通行做法, 双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时;  
2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障投资人的利益, 决定延迟估值;

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人, 由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时, 所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因, 或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误, 或国家会计政策变更、市场规则变更等, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但未能发现错误的, 由此造成的基金资产估值错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金方式；

（2）本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（3）在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 12 次，各基金份额类别的每次收益分配最低比例为基金收益分配基准日相应的基金份额类别的可供分配利润的 10%；

（4）基金收益分配基准日的各类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日是指基金管理人以该日的可供分配利润为基准拟定基金收益分配方案；

（5）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（6）基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

（7）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金



收益分配对象、分配时间、分配数额及比例等内容。

（五）收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（六）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
4. 基金财产拨划支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 指数使用费；
10. 证券账户开户费用、银行账户维护费用；
11. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金份额的销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 4、指数使用费

基金合同生效后，需根据指数使用许可协议的要求向标的指数的发布方恒生指数有限公司支付指数使用费。在通常情况下，指数使用费的计费时间从基金合同生效日开始计算，按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经由基金管理人向恒生指数有限公司支付上一季度的指数使用费。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

指数使用费的收取下限为每月人民币 7,500 元（若基金成立当月剩余时间不足一个月，且按当月实际剩余时间计算的指数使用费低于人民币 7,500 元，则按照人民币 7,500 元收取）。

如果指数使用费的费率或计算方法发生变动，本基金将采取调整后的费率和计算方法计算指数使用费。基金管理人必须按照《信息披露管理办法》的规定在

指定媒体及时公告。

5、除管理费、托管费和标的指数使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

### （五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十七、基金的会计和审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，经书面通知基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制基金招募说明书，并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并

登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## （四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （五）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## （六）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

## （七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### （八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；



- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加或减少代销机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

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

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

#### （十一）中国证监会规定的其他信息

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十九、风险揭示

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

#### （1）政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### （2）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### （3）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### （5）通货膨胀风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### （6）债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

### （7）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

### （四）流动性风险

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资人的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

### （五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

### （六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

### （七）本基金特有的风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （八）其他风险

（1）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

（2）因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

（3）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

（4）其他意外导致的风险。

## 二十、基金的变更、终止与清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的以下内容应经基金份额持有人大会决议同意。

（1）转换基金运作方式；

（2）变更基金类别；

（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（4）变更基金份额持有人大会程序；

（5）更换基金管理人、基金托管人；

（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；

（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备

案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、法律法规、中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算组

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

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

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

### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （8）参加与基金财产有关的民事诉讼；

- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十一、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1. 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

### 2. 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 3. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自本基金合同生效日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 发售基金份额；

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率、管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

(6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

(8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

(9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

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

(12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 4. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

(10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(12) 编制季度、半年度和年度基金报告;

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

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

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

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

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

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

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

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

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 5. 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效日起，依法保管基金资产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 6. 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

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

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

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

(18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

2. 召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止基金合同；

2) 转换基金运作方式；

3) 变更基金类别；

4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

5) 变更基金份额持有人大会程序；

6) 更换基金管理人、基金托管人；

7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

8) 本基金与其他基金的合并；

9) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的标的指数使用费、申购费率、调低赎回费率；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出



席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

5) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会召开基金份额持有人大会。

## (2) 召开基金份额持有人大会的条件

### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会的基金份额持有人在权益登记日持有基金份额的统计显示，其所持有的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，监督人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 6. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的

除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当在基金份额持有人大会召开 30 日前公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会, 不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50% 以上通过方为有效, 除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以

一般决议的方式通过；

## 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 8. 计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人或基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会

主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

#### 10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

#### (三) 基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

##### 1. 基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的以下内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 转换基金运作方式；

2) 变更基金类别；

3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

4) 变更基金份额持有人大会程序；

5) 更换基金管理人、基金托管人；

6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该

等报酬标准的除外；

- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

## 2. 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同在履行相关程序后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 中国证监会规定的其他情况。

## 3. 基金财产的清算

### (1) 基金财产清算组

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

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务

资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国

证监会备案并公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议解决方式

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

本基金合同在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。



## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼

邮政编码：200120

法定代表人：杨小勇

成立时间：2005 年 11 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】172 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；及中国证监会认可的其他业务。

#### 2. 基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融街 3 号 A 座

邮政编码：100808

法定代表人：李国华

成立时间：2007 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484 号

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673 号

组织形式：股份有限公司

注册资金：450 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的 90%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

基金管理人于基金合同生效后五个工作日将标的指数成份股及备选成份股的股票池信息以传真或双方认可的其他方式交与基金托管人，并电话确认，确保基金托管人收到；标的指数成份股及备选成份股的股票池信息在基金合同生效后每季度更新一次，基金管理人应于每季度股票池更新后五个工作日内将更新后的股票池信息交与基金托管人，并电话确认，确保基金托管人收到。

在基金实际管理过程中，本基金具体资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人在履行相关程序后，可对上述比例做适度调整。

2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

- a. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- b. 本基金持有的现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- c. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金持有的同一资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- d. 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- e. 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 25%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；
- f. 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- g. 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的从其规定。

如果法律法规对基金合同约定的投资组合限制进行变更的，以变更后的规定为准。如《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资不再受上述限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联交易限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行向基金管理人电话确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人

参与银行间债券市场进行监督。

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

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 2 个工作日内与基金托管人确认，基金托管人于 1 个工作日内当日向基金管理人电话确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人撤销交易，基金管理人仍不撤销的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规定的除外。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任，但有权报告中国证监会，法律法规另有规定的除外。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式。基金管理人仍不重新确定交易方式的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规

定的除外。

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

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

本基金投资银行存款应符合如下规定:

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

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

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

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

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算,若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失,基金托管人不承担任何责任。

(7) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。

1) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 在投资流通受限证券之前, 基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应根据本基金的投资风格和流动性的需要, 合理控制基金投资非公开发行股票等流通受限证券的比例, 并在风险控制制度中明确具体比例, 避免出现流动性风险。投资流程及风险控制制度需经董事会授权, 其中投资非公开发行股票, 基金管理人董事会还应批准相关流动性风险处置预案, 一旦因投资非公开发行股票出现流动性风险, 由基金管理人承担该风险, 具体规定依据相关法律法规执行。上述规章制度经董事会通过之后, 基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4) 基金管理人管理的基金在投资流通受限证券前, 应按照审慎的风险控制原则, 向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息, 包括但不限于拟发行证券主体的资格证明、发行证券数量、定价依据、募集资金投向、承销商、发行期限、流通受限期限, 管理人管理的基金拟认购的数量、价格、占基金资产净值的比例、划付账号、划付款项、划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整, 并至少于拟执行投资指令的前两日将上述信息书面发至托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人如对基金管理人的投资运作存在疑义, 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查, 并就基金托管人的疑义进行解释或举证, 如投资运作行为违反相关规定的, 基金管理人应及时改正或补救。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的, 基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

6) 基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。如果基金托管人没有切实履行监督职责, 导致基金出现风险, 基金托管人应承担连带责任。如果基金托管人切实履行了监督职责, 则不承担任何责任。

(8) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金资产净

值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(9) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在上述规定期限内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

(10) 对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(11) 基金托管人发现基金管理人存在重大违法、违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 2. 基金管理人对基金托管人的业务核查

(1) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、及时、准确



复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值，根据基金管理人指令办理清算交收且如遇到问题应及时反馈、相关信息披露和监督基金投资运作是否对非公开信息保密等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

(2) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正等。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### (三) 基金财产的保管

#### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照法律法规的规定、基金合同和本协议的约定保管基金财产。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

(7) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2. 基金募集期间及募集资金的验资

(1) 本基金募集期间募集的资金应存于基金管理人或基金管理人委托的注册登记机构开立的专门账户。

(2) 本基金募集期届满之日前，投资者的认购款项只能存入基金募集专户，任何人不得动用。有效认购资金在募集期形成的利息将折算成基金份额，归基金份额持有人所有。利息及利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。2、基金募集期满或基金提前结束募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金托管账户，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件，基金管理人在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的托管账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托

管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金托管账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管账户办理基金资产的支付。

#### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户并报中国人民银行备案，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

## 6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

## 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

## 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管，相关业务程序另有限制除外。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 10 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### (四) 基金资产净值计算与会计复核

#### 1. 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### (1) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额所得数值。基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核无误后，按规定公告。

## （2）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（3）根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人的计算结果对外予以公布。

## 2. 基金资产估值方法和特殊情形的处理

### （1）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （2）估值方法

#### 1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交

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

2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据法律法规，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### (3) 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按第(2)条估值方法的第5)款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值

错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 3. 估值错误的处理方式

(1) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金资产净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

#### (2) 差错处理原则

① 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

② 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

④ 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

⑤ 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金

托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，从基金资产中支付。

⑥如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

⑦按法律法规规定的其他原则处理差错。

本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任。

若基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

如基金管理人和基金托管人对基金资产净值、基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金资产净值、基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担任何责任。

4. 暂停估值与公告基金份额净值的情形

- 1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；

4) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

5. 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。



## 6. 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

## 7. 基金财务报表与报告的编制和复核

### 1) 财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内完成半年度报告编制并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并予以公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

### 2) 报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部业务专用章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当

发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

8. 基金管理人应每周向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （六）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### （七）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2. 基金托管协议终止出现的情形

- (1) 基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### 3. 基金财产的清算

(1) 基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### (2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;

9) 公布基金财产清算结果;

10) 对基金剩余财产进行分配。

(4) 清算费用

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

(5) 基金财产清算剩余资产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿:

1) 支付基金财产清算费用;

2) 缴纳基金所欠税款;

3) 清偿基金债务;

4) 清算后如有余额,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1) —3) 项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

(6) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

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

### （一）账单服务

本基金管理人默认的对账单方式为电子对账单，电子对账单包括电子邮件形式对账单（月度、季度）和短信账单（月度）。对于已订制电子邮件形式对账单的基金持有人，我公司将继续发送电子邮件对账单；对于没有订制电子邮件对账单的客户，默认向预留有效手机号码的基金持有人发送短信账单，向预留有效电子邮箱的基金客户发送电子邮件对账单。

若基金持有人因特殊原因需获取某段时间的纸质对账单，可拨打本基金管理人客服电话 021-20376888 按 0 转人工服务，客服人员核对姓名、开户证件或基金账号、交易信息、邮寄地址及邮编等信息无误后，将为基金持有人免费邮寄纸质对账单。

### （二）基金间转换服务

基金管理人已于 2012 年 8 月 31 日开通本基金的转换业务。

### （三）定期投资计划

基金管理人已于 2012 年 8 月 31 日开通本基金的定期投资计划。

### （四）网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、修改查询密码等服务。

公司网址：[www.hsbcjt.cn](http://www.hsbcjt.cn)

电子信箱：[services@hsbcjt.cn](mailto:services@hsbcjt.cn)

### （五）信息定制服务

汇丰晋信将为客户提供各类资讯服务，包括市场资讯，理财资讯，旗下基金信息等。基金持有人可以通过汇丰晋信网站、客户服务热线提交资讯定制的申请，基金管理人通过手机短信和 E-MAIL 方式定期发送持有人定制的信息。可定制的信息包括：基金净值、公司最新公告提示，各类定期及不定期的市场报告、理财资讯等。

除了发送持有人定制的上述信息之外，基金管理人也会不定期向留有手机和留有 EMAIL 地址的客户发送节日及生日问候、产品推广等信息。如持有人不希望接受到该类信息，可以通过客户服务热线取消该项服务。

### （六）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

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

呼叫中心人工座席每个交易日 9:00-18:00 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服电话：021-20376888

传真：021-20376998

### （七）投诉受理

投资人可以拨打汇丰晋信基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 2 个工作日之内对投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

### （八）网上开户与交易服务

目前，基金管理人已经利用自己的网站（www.hsbcjt.cn）及客服电话 021-20376888 为基金投资人提供方便快捷的电子交易服务。

## 二十四、其他应披露事项

（一）2016年8月2日至2017年2月1日未发生涉及基金管理人和基金财产的诉讼、仲裁事项。

（二）2016年8月2日至2017年2月1日本基金管理人的高级管理人员未有受到任何处分。

（三）2016年8月2日至2017年2月1日相关公告事宜列示如下，下列公告刊登在上海证券报、中国证券报、证券时报和汇丰晋信基金管理有限公司网站上。

披露时间	公告内容
2016-8-2	汇丰晋信基金管理有限公司关于投资者通过交通银行借记卡进行基金网上直销申购和转换业务实行优惠费率的公告
2016-8-27	基金2016年半年度报告
2016-9-3	关于汇丰晋信基金管理公司旗下基金持有的复牌股票继续采用指数收益法进行估值的提示性公告
2016-9-14	指数基金更新招募说明书（2016年第2号）
2016-9-20	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告
2016-10-26	汇丰晋信基金2016年3季报
2016-11-16	关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告
2016-11-30	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告
2016-12-16	汇丰晋信关于提示基金直销客户及时更新身份证件或者身份证明文件并接受或重新接受风险承受能力调查的公告
2016-12-22	汇丰晋信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告
2016-12-30	汇丰晋信旗下部分基金关于参加工商银行“2017倾心回馈”基金定投优惠活动的公告
2016-12-30	汇丰晋信基金管理有限公司关于通过农业银行网上银行、掌上银行开展基金申购和定期定额申购费率优惠活动的公告
2017-1-3	汇丰晋信旗下开放式基金净值公告
2017-1-19	汇丰晋信基金 2016 年 4 季报
2017-1-19	基金行业高级管理人员变更公告

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人应保证与所公告的内容完全一致。



## 二十六、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和代销机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

(一) 中国证监会核准汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金募集的文件；

(二) 《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金基金合同》；

(三) 《汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金托管协议》；

(四) 法律意见书；

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；

(七) 《汇丰晋信基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

(八) 中国证监会要求的其他文件。

汇丰晋信基金管理有限公司

二〇一七年三月十八日