

**平安沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金招募说明书(更新)  
2019 年第 1 期**

**基金管理人：平安基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

**截止日期：2019 年 6 月 24 日**

## 【重要提示】

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2017 年 11 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2017】2055 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2017 年 12 月 25 日正式生效。

基金管理人保证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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。本基金属股票型基金，其风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在股票型基金中属于指数型基金，主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现，本基金的业绩表现与沪深 300 指数的表现密切相关。

证券投资基金分为股票基金、混合基金、债券基金、基金中基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以 1 元初始面值开展基金募集或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值或 1 元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票。本基金资产并非必然投资科创板股票。

本基金可投资科创板股票，除了需要承担与A股类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临科创板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括科创板上市企业经营风险、科创板股票的流动性风险、科创板上市企业退市风险、科创板股票价格波动风险等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

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，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括：指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离度和跟踪误差的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、退市风险、第三方机构服务的风险等。投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，本基金管理人不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书（2019年第1期）所载内容截止日期为2019年6月24日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2019年3月31日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司于 2019 年 7 月 8 日对本招募说明书（2019 年第 1 期）进行了复核。

## 目 录

一、绪言.....	6
二、释义.....	7
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	23
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集.....	40
七、基金合同的生效.....	41
八、基金份额折算和变更登记.....	42
九、基金份额的上市交易.....	43
十、基金份额的申购与赎回.....	45
十一、基金的投资.....	69
十二、基金的业绩.....	82
十三、基金的财产.....	84
十四、基金资产的估值.....	85
十五、基金收益与分配.....	90
十六、基金的费用与税收.....	92
十七、基金的信息披露.....	95
十八、基金的会计与审计.....	101
十九、风险揭示.....	102
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	110
二十一、基金合同的内容摘要.....	112
二十二、托管协议的内容摘要.....	139
二十三、对基金份额持有人的服务.....	153
二十四、其他应披露事项.....	155
二十五、对招募说明书更新部分的说明.....	156
二十六、招募说明书的存放及查阅方式.....	157
二十七、备查文件.....	158

## 一、绪言

《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他相关法律法规的规定以及《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（原平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金）

2、基金管理人或本基金管理人：指平安基金管理有限公司（原平安大华基金管理有限公司）

3、基金托管人或本基金托管人：指中国工商银行股份有限公司

4、基金合同：指《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对该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《平安沪深 300 交易型开放式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《平安沪深 300 交易型开放式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《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书：指《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《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

13、《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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的自然人

19、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企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、投资者：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者的合称

22、交易型开放式指数证券投资基金、ETF：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”

23、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

24、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者

25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回等业务

26、直销机构：指平安基金管理有限公司

27、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构、办理本基金申购赎回业务的申购赎回代理券商（代办证券公司）



28、销售机构：指直销机构和代销机构

29、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

30、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

31、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

32、登记结算业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

33、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构是中国证券登记结算有限责任公司（简称“中国结算”）或基金管理人指定的其他机构

34、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

35、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

36、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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日

40、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

41、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43、业务规则：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定

44、认购：指在基金募集期内，投资者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

45、申购：指基金合同生效后，投资者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

46、赎回：指在本基金存续期内，基金投资人向基金管理人申请将其持有的本基金基金份额转换为基金合同约定的赎回对价的行为

47、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

48、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

49、赎回对价：是指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

50、标的指数：指本基金跟踪的基准指数，即中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 指数及其未来可能发生的变更

51、完全复制法：指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的

52、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

53、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

54、现金替代：指申购或赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

55、现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按 T 日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

56、基金份额参考净值：指上海证券交易所交易时间内发布的由基金管理人或中证指数有限公司根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算的基金份额参考净值，简称 IOPV

57、基金份额折算：指基金管理人根据基金合同规定在不改变投资者权益的

前提下将投资者的基金份额净值及数量进行相应调整的行为

58、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

59、元：指人民币元

60、基金份额净值增长率：指基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算，如本基金实施份额拆分、合并，将按经拆分、合并调整后的基金份额折算日的基金份额净值来计算相应基金份额的累计收益率）

61、同期标的指数增长率：指标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算或拆分、合并日为初始日重新计算）

62、基金资产总值：指基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

63、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

64、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总数

65、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

66、货币市场工具：现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具

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

68、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：平安基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

法定代表人：罗春风

成立日期：2011 年 1 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监许可【2010】1917 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币 130,000 万元

存续期限：持续经营

联系人：吴小红

联系电话：0755-22623179

股东名称、股权结构及持股比例：

股东名称	出资额（万元）	出资比例
平安信托有限责任公司	88,647	68.19%
大华资产管理有限公司	22,763	17.51%
三亚盈湾旅业有限公司	18,590	14.3%
合计	130,000	100%

基金管理人无任何重大行政处罚记录。

客服电话：400-800-4800（免长途话费）

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事、监事及高级管理人员

###### （1）董事会成员

罗春风先生,董事长, 博士, 高级经济师。1966 年生。曾任中华全国总工会国际部干部, 平安保险集团办公室主任助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司

总经理。现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大华汇通财富管理有限公司执行董事。

姚波先生，董事，硕士，1971年生。曾任 R.J.Michalski Inc.（美国）养老金咨询分析员、Guardian Life Ins.Co（美国）助理精算师、Swiss Re（美国）精算师、Deloitte Actuarial Consulting Ltd.（香港）精算师、中国平安保险（集团）股份有限公司副总精算师、总经理助理等职务，现任中国平安保险（集团）股份有限公司常务副总经理兼首席财务官兼总精算师。

陈敬达先生，董事，硕士，1948年生，新加坡。曾任香港罗兵咸会计师事务所审计师；新鸿基证券有限公司执行董事；DBS 唯高达香港有限公司执行董事；平安证券有限责任公司副总经理；平安证券有限责任公司副董事长/副总经理；平安证券有限责任公司董事长；中国平安保险（集团）执行委员会执行顾问，现任集团投资管理委员会副主任。

肖宇鹏先生，董事，学士，1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安华基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司总经理。

杨玉萍女士，董事，学士，1983年生。曾于平安数据科技（深圳）有限公司从事运营规划，现任平安保险（集团）股份有限公司人力资源中心薪酬规划管理部高级人力资源经理。

叶杨诗明女士，董事，硕士，1961年生，加拿大籍。曾任职于澳新银行、渣打银行、汇丰银行并担任高级管理职务。2011年加入大华银行集团，现任大华银行有限公司董事总经理兼香港区总裁兼大华银行（中国）有限公司非执行董事，同时兼任瑞士德科集团顾问、崇侨托管（香港）有限公司董事、数码通电讯集团独立非执行董事、United Investments Private Ltd 董事、United Orient Capital G.P. Ltd 董事、大华银行托管（香港）有限公司董事、United Pte Equity Investments (Cayman) Ltd 董事、新加坡大华亚洲（香港）有限公司董事、大华投资管理（上海）有限公司董事。

张文杰先生，董事，学士，1964年生，新加坡。现任大华资产管理有限公司执行董事及首席执行官，新加坡投资管理协会执行委员会委员。历任新加坡政府投资公司“特别投资部门”首席投资员，大华资产管理有限公司组合经理，国际股票和全球科技团队主管。

薛世峰先生，独立董事，硕士，1963 年生。曾任江西省行政学院老师、深圳市龙岗区投资管理公司投资部部长、龙岗实业股份有限公司总经理、法定代表人、深圳市鑫德莱实业有限公司总经理助理兼房地产部部长、监事会主席、法律顾问，后加入广东万乘律师事务所任专职律师，现任广东宏泰律师事务所高级合伙人、专职律师。

李娟娟女士，独立董事，学士，1965 年生。曾任安徽商业高等专科学校教师、深圳兴粤会计师事务所项目经理、深圳职业技术学院经济系教师、会计专业主任、深圳职业技术学院计财处处长；现任深圳职业技术学院经济学院副院长。

刘雪生先生，独立董事，硕士，1963 年生。曾任深圳蛇口中华会计师事务所审计员、深圳华侨城集团会计师、财务经理、子公司副总经理、总会计师、深圳市注册会计师协会部门临时负责人、秘书长助理；现任深圳市注册会计师协会副秘书长。

潘汉腾先生，独立董事，学士，1949 年生。曾任新加坡赫乐财务有限公司助理经理、新加坡花旗银行副总裁、新加坡大华银行高级执行副总裁；现任彩日本料理私人有限公司非执行董事、一合环保控股有限公司独立董事、速美建筑集团有限公司独立董事、华业集团有限公司独立董事。

## （2）监事会成员

巢傲文先生，监事长，硕士，1967 年生。曾任江西客车厂科室助理工程师；深圳市龙岗区投资管理公司经济研究部科员；平安银行（原深圳发展银行）营业部柜员、副主任、支行会计部副主任、总行电脑部规划室经理、总行零售银行部综合室经理、总行稽核部零售稽核室主管、总行稽核部总经理助理；广东南粤银行总行稽核监察部副总经理（主持工作）、总行人力资源部总经理、惠州分行筹建办主任、分行行长、总行稽核部总经理；现任职于中国平安保险(集团)股份有限公司稽核监察部总经理室，兼任重庆金融资产交易所监事会主席。

冯方女士，监事，硕士，1975 年生，新加坡。曾任职于淡马锡控股和旗下的富敦资产管理公司以及新加坡毕盛资产公司、鼎威资本管理公司。于 2013 年加入大华资产管理，现任区域总办公室主管。

郭晶女士，监事，硕士，1979 年生。曾任广东溢达集团研发总监助理、侨鑫集团人力资源管理岗；现任平安基金管理有限公司人力资源室副经理。

李峥女士，监事，硕士，1985年生。曾任德勤华永会计师事务所高级审计员、深圳市宝能投资集团财务部会计主管，现任平安基金管理有限公司监察稽核岗。

### （3）公司高级管理人员

罗春风先生，博士，高级经济师。1966年生。曾任中华全国总工会国际部干部，平安保险集团办公室主任助理、平安人寿广州分公司副总经理、平安人寿总公司人事行政部/培训部总经理、平安保险集团品牌宣传部总经理、平安人寿北京分公司总经理、平安基金管理有限公司副总经理、平安基金管理有限公司总经理，现任平安基金管理有限公司董事长兼任深圳平安大华汇通财富管理有限公司执行董事。

肖宇鹏先生，学士，1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长；现任平安基金管理有限公司总经理。

付强先生，博士，高级经济师，1969年生。曾任中国华润总公司进出口副科长、申银万国证券研究所任高级研究员、申万巴黎基金管理公司高级研究经理、安信证券首席分析师、嘉实基金管理公司产品总监、平安证券有限责任公司副总经理。现任平安基金管理有限公司副总经理。

林婉文女士，1969年生，毕业于新加坡国立大学，拥有学士和荣誉学位，新加坡籍。曾任新加坡国防部职员，大华银行集团助理经理、电子渠道负责人、个人金融部投资产品销售主管、大华银行集团行长助理，大华资产管理公司大中华区业务开发主管，高级董事。现任平安基金管理有限公司副总经理。

汪涛先生，1976年生，毕业于谢菲尔德大学，金融硕士学位。曾任海赛宁国际贸易有限公司销售经理、汇丰银行上海分行市场代表、新加坡华侨银行产品经理、渣打银行产品主管、宁波银行总行个人银行部总经理助理、总行审计部副总经理、总行资产托管部副总经理、永赢基金管理有限公司督察长。现任平安基金管理有限公司副总经理。

陈特正先生，督察长，学士，1969年生。曾任深圳发展银行龙岗支行行长助理，龙华支行副行长、龙岗支行副行长、布吉支行行长、深圳分行信贷风控部总经理、平安银行深圳分行信贷审批部总经理、平安银行总行公司授信审批部高级审批师、平安银行沈阳分行行长助理兼风控总监。现任平安基金管理有限公司督察长。

## 2、基金经理

成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安基金管理有限公司，现任平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金（2017-12-25至今）、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金（2018-03-23至今）、平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-04-04至今）、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金（2018-06-15至今）、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金（2018-06-07至今）、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-06-21至今）、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2018-09-05至今）、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金（2019-03-15至今）基金经理。

### 3、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：总经理肖宇鹏先生，权益投资中心投资董事总经理李化松先生，衍生品投资中心投资执行总经理 DANIEL DONGNING SUN 先生、研究中心研究执行总经理张晓泉先生、基金经理黄维先生。

肖宇鹏先生，学士，1970年生。曾任职于中国证监会系统、平安基金管理有限公司督察长；现任平安基金管理有限公司总经理。

李化松先生，北京大学经济学硕士，曾先后担任国信证券股份有限公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司，现任平安基金权益投资中心投资董事总经理。现担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安核心优势混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

DANIEL DONGNING SUN 先生，北京大学硕士，美国哥伦比亚大学博士，约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014年10月加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精



选沪港深股票型证券投资基金基金经理。

张晓泉先生，清华大学材料科学与工程专业硕士，曾先后担任广发证券股份有限公司研究员、招商基金管理有限公司研究员、国投瑞银基金管理有限公司研究总监助理。2017年10月加入平安基金管理有限公司，任研究中心研究执行总经理，现担任平安新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。

黄维先生，北京大学微电子学硕士，2010年7月起先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理，于2016年5月加入平安基金管理有限公司，现任平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集资金，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》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、编制并公告申购赎回清单，计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购对价、赎回对价；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价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、足额支付赎回对价；
- 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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 15、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 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、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 18、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 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、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 21、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 22、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 23、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- 24、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

25、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；

26、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

27、建立并保存基金份额持有人名册；

28、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

##### 1、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

（1）、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

（2）、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

1) 将基金管理人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) 侵占、挪用基金财产；

6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

（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) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

8) 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、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

## 2、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

(1)、承销证券和投资股票；

(2)、违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；

(5)、向基金管理人、基金托管人出资；

(6)、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7)、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

## 3、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)、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3)、不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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(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、内部控制制度概述**

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

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

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

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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

### **2、内部控制原则**

**健全性原则。**内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

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

**独立性原则。**公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

**相互制约原则。**公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

**成本效益原则。**公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，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、主要内部控制制度

#### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

#### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

#### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会相关机构认可。根据公司监察稽核工作的需要，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立法律合规监察部开展监察稽核工作，并保证法律合规监察部的独立性和权威性。公司明确了法律合规监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

法律合规监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### 2、主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、

内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的64项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017、2018共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则



（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营

销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管

部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

### 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

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

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

平安基金管理有限公司

办公地址：深圳福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 楼

法定代表人：罗春风

直销电话：0755-22627627

直销传真：0755-23990088

联系人：郑权

网址：[www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com)

#### 2、申购赎回代办券商

##### (1) 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中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38032284

客服电话：95521

传真：021-38670666

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

##### (2) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

联系电话：010-65608231

客服电话：400-8888-108

传真：010-65182261

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

(3) 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：李颖

联系电话：0755-82133066

客服电话：95536

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

(4) 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：霍达

联系人：黄婵娟

联系电话：0755-82943666

客服电话：95565；400-8888-111

传真：0755-82943636

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

(5) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广场知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17-19、38-44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575

传真：020-87557689

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

(6) 中信证券股份有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

联系电话：010-60838888

客服电话：95548

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

(7) 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 2-6 层

办公地址：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：陈共炎

联系人：辛国政

客服电话：400-8888-888/95551

传真：010-83574807

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

(8) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219275

客服电话：95553

传真：021-23219100

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

(9) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

联系电话：021-33388229

客服电话：95523 或 4008895523

传真：021-33388224

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

(10) 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：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客服电话：95562

传真：0591-38507538

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

(11) 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：尤习贵

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

客服电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

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

(12) 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：王连志

联系人：陈剑虹

电话：0755-82555551

客服电话：400-800-1001

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

(13) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

电话：023-63786633

客服电话：95355、400-8096-096

传真：023-63786212

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

(14) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451922

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

(15) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

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

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：0532-96577

传真：0532-85022605

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

(16) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客服电话：95503

传真：021-63326173

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

(17) 长城证券有限责任公司



注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：0755 -83516289

客服电话：400-6666-888

传真：0755—83515567

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

(18) 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：薛峰

联系人：何耀、李芳芳

联系电话：021-22169999

客服电话：95525

传真：021-22169134

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

(19) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客服电话：95360

传真：0431-85096795

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(20) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

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

(21) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号7-9层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号7-9层

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

电话：051082831662

传真：0510-82830162

客服电话：95570

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

(22) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

客服电话：400-8816-168

传真：0755-82400862

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(23) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

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

(24) 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：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

传真：010-88085195

客服电话：4008000562

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

(25) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 20518 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号证券大厦

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315117

客服电话：95538

传真：0531-68889752

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

(26) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘熠

电话：021-68761616

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

(27) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：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：俞洋

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967552

传真电话：021-54967293

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

(28) 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：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

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

(29) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：岑妹妹

电话：027-87617017

客服电话：95391/400-800-5000

网址：<http://www.tfzq.com>

(30) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-3953168

传真：0471-3979545

客服电话：400-196-6188

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

(31) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：高利

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

客服电话：95571

传真：010-57398058

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

(32) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：95321

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

(33) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

电话：029-63387289

传真：029-81887060

客服电话：400-860-8866

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

(34) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：毕明建（代）

联系人：刘书剑

电话：0755-83196207

传真：0755-83196250

客服电话：0755-83196207

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

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-59378856

传真：010-59378907

联系人：崔巍

## （三）出具法律意见书的律师事务所

律师事务所：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-3135 8666

传真：021-3135 8600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

## （四）审计基金财产的会计师事务所

会计师事务所：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 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

联系电话：021 2323 8888

传真电话： 021 2323 8800

经办注册会计师：曹翠丽、陈怡

联系人：陈怡

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可文准予募集注册，并于2017年11月8日经中国证监会证监许可[2017]2055号文准予募集注册。

自2017年12月4日至2017年12月15日，本基金面向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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者同时发售，共募集5,723,055,617.00份，有效认购户数为10,101户。



## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于2017年12月25日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额折算和变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。

### （一）基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

### （二）基金份额折算的原则

根据投资需要（如变更标的指数）或为提高交易便利，基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算由基金管理人办理并由登记结算机构进行基金份额变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### （三）基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

- 1、基金募集金额（含网下股票认购募集的股票市值）不低于2亿元人民币；
- 2、基金份额持有人不少于1,000人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

本基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应按规定在指定媒介上刊登基金上市交易公告书。

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### （三）基金份额终止上市交易

本基金基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本部分第一款规定的上市条件。
- 2、基金合同终止。
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市。
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形。
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

若因上述1、3、4、5项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金可由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，而无需召开基金份额持有人大会。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后可以选取其他合适的指数作为标的指数。

### （四）基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，基金管理人或中证指数有限公司在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

#### 1、基金份额参考净值计算公式

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购赎回单位对应的基金份额

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。若上海证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、上海证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式、公告频率或决定不再披露 IOPV，并予以公告。

（五）在法律法规允许并且不损害届时基金份额持有人利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在其他证券交易所（含境外证券交易所）同时挂牌交易。

（六）法律法规、监管部门和登记结算机构、上海证券交易所业务规则对上市交易另有规定的，从其规定。

（七）若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 十、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所，或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，并予以公告。在相关条件许可的前提下，基金管理人可增加或调整申购赎回代理券商，并予以公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2018年1月26日开始办理申购和赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“份额申购、份额赎回”原则，即申购和赎回均以份额申请；
- 2、基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价；
- 3、申购与赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定。如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在对基金份额持有人利益无实质性

不利影响的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （四）申购和赎回的数额限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需按最小申购赎回单位或其整数倍进行申报，本基金最小申购、赎回单位为90万份。各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高最低申购金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

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

3、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （五）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序，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申购赎回代理券商规定的方式依照申购赎回清单备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，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

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

基金销售机构受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。

对于本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购当日并卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上交所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不得迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## （六）申购和赎回的数额和价格

1、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。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单由基金管理人编制，T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

2、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

### （七）申购赎回清单的内容与格式

#### 1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

#### 2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

#### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

（1）现金替代分为4种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退



补”）。

禁止现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

退补现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

## （2）可以现金替代

□适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于沪深 300 指数中的上海证券交易所上市的成份股。

□替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比率)

其中，该证券参考价格为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

□替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比率，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 N+2 日）内，

基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。N+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照N+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至N+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

N+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

□替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例（\%）} = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格} \times 100\%}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}}$$

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。参考基金份额净值目前为该ETF前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除，或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的 T 日开盘参考价。

#### （4）退补现金替代

□适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于沪深 300 指数深圳证券交易所上市的成份股；

□替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×(1+现金替代溢价比例)；

赎回的替代金额=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×(1-现金替代溢价比例)。

□替代金额的处理程序

对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

对退补现金替代而言，赎回时扣除现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

其中，调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实

时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T日未完成的交易，基金管理人在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为N+2日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于T日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T日后基金管理人可以继续完成被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

N+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

N+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 N+2 日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

N+2 日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

#### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

预估现金部分的计算公式为：

$T$  日预估现金部分 =  $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与该证券调整后  $T$  日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券调整后  $T$  日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券调整后  $T$  日开盘参考价相乘之和)

其中，该证券调整后  $T$  日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份股的调整后开盘参考价确定。另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

$T$  日现金差额在  $T+1$  日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

$T$  日现金差额 =  $T$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与  $T$

日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和)

T 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 6、申购赎回清单的格式

基金管理人有权根据业务需要对申购、赎回清单的格式进行修改。

申购赎回清单的格式举例如下：

##### 基本信息（示例）

最新公告日期	2017-03-08
基金名称	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	平安基金管理有限公司
一级市场基金代码	

##### 2017-03-07 信息内容

现金差额(单位：元)	0.00
最小申购、赎回单位资产净值(单位：元)	3,000,000.00
基金份额净值(单位：元)	1.3333

##### 2017-03-08 信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位：元)	-45133
最小申购、赎回单位(单位：份)	3,000,000.00
现金替代比例上限	50.00%

是否需要公布 IOPV	是
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回
申购上限	
赎回上限	

## 组合证券替代信息内容

证券代码	证券简称	股票数量 (股)	现金替代标志	现金替代溢价 比率	替代金 额(单 位:人民 币元)
000001	平安银行	2900	深市退补现金替代	10%	26448
000002	万科A	2300	深市退补现金替代	10%	48921
000008	神州高铁	300	深市退补现金替代	10%	2565
000009	中国宝安	700	深市退补现金替代	10%	6664
000027	深圳能源	400	深市退补现金替代	10%	2788
000039	中集集团	300	深市退补现金替代	10%	4881
000060	中金岭南	500	深市退补现金替代	10%	5615
000061	农产品	200	深市退补现金替代	10%	2258
000063	中兴通讯	800	深市退补现金替代	10%	14008
000069	华侨城A	1100	深市退补现金替代	10%	8019
000100	TCL集团	2400	深市退补现金替代	10%	8712
000156	华数传媒	200	深市退补现金替代	10%	3430
000157	中联重科	1500	深市退补现金替代	10%	7245
000166	申万宏源	2000	深市退补现金替代	10%	12540
000333	美的集团	1500	深市退补现金替代	10%	50925
000338	潍柴动力	800	深市退补现金替代	10%	9056
000402	金融街	400	深市退补现金替代	10%	4440
000413	东旭光电	600	深市退补现金替代	10%	6738

000415	渤海金控	600	深市退补现金替代	10%	4260
000423	东阿阿胶	200	深市退补现金替代	10%	12836
000425	徐工机械	1400	深市退补现金替代	10%	5726
000503	海虹控股	200	深市退补现金替代	10%	6750
000538	云南白药	200	深市退补现金替代	10%	17228
000540	中天城投	900	深市退补现金替代	10%	6102
000555	神州信息	100	深市退补现金替代	10%	2111
000559	万向钱潮	400	深市退补现金替代	10%	4916
000568	泸州老窖	200	深市退补现金替代	10%	8200
000623	吉林敖东	200	深市退补现金替代	10%	6090
000625	长安汽车	600	深市退补现金替代	10%	9396
000627	天茂集团	400	深市退补现金替代	10%	3000
000630	铜陵有色	2100	深市退补现金替代	10%	6657
000651	格力电器	1600	深市退补现金替代	10%	49280
000671	阳光城	500	深市退补现金替代	10%	2775
000686	东北证券	500	深市退补现金替代	10%	6045
000709	河钢股份	1400	深市退补现金替代	10%	5096
000712	锦龙股份	100	深市退补现金替代	10%	2404
000718	苏宁环球	400	深市退补现金替代	10%	2892
000725	京东方 A	7900	深市退补现金替代	10%	27571
000728	国元证券	400	深市退补现金替代	10%	8376
000738	中航动控	200	深市退补现金替代	10%	4918
000750	国海证券	1000	深市退补现金替代	10%	6510
000768	中航飞机	500	深市退补现金替代	10%	12035
000776	广发证券	1000	深市退补现金替代	10%	17160
000778	新兴铸管	700	深市退补现金替代	10%	3941
000783	长江证券	1100	深市退补现金替代	10%	10956
000792	盐湖股份	200	深市退补现金替代	10%	3740
000793	华闻传媒	700	深市退补现金替代	10%	7819



000800	一汽轿车	300	深市退补现金替代	10%	3456
000826	启迪桑德	200	深市退补现金替代	10%	6886
000839	中信国安	900	深市退补现金替代	10%	10026
000858	五 粮 液	600	深市退补现金替代	10%	25662
000876	新 希 望	700	深市退补现金替代	10%	5712
000895	双汇发展	300	深市退补现金替代	10%	6855
000917	电广传媒	400	深市退补现金替代	10%	5684
000938	紫光股份	100	深市必须现金替代		5689
000963	华东医药	100	深市退补现金替代	10%	9028
000977	浪潮信息	200	深市退补现金替代	10%	3902
000983	西山煤电	500	深市退补现金替代	10%	4605
001979	招商蛇口	800	深市退补现金替代	10%	14128
002007	华兰生物	200	深市退补现金替代	10%	7242
002008	大族激光	300	深市退补现金替代	10%	7722
002024	苏宁云商	1200	深市退补现金替代	10%	13056
002027	分众传媒	200	深市退补现金替代	10%	2374
002049	紫光国芯	100	深市必须现金替代		3088
002065	东华软件	300	深市退补现金替代	10%	6444
002074	国轩高科	100	深市退补现金替代	10%	3209
002081	金螳螂	500	深市退补现金替代	10%	5640
002085	万丰奥威	300	深市退补现金替代	10%	6480
002129	中环股份	400	深市必须现金替代		3308
002131	利欧股份	200	深市退补现金替代	10%	2974
002142	宁波银行	600	深市退补现金替代	10%	10854
002146	荣盛发展	400	深市退补现金替代	10%	3500
002152	广电运通	300	深市退补现金替代	10%	3948
002153	石基信息	100	深市退补现金替代	10%	2230
002174	游族网络	100	深市退补现金替代	10%	2823
002183	怡亚通	500	深市退补现金替代	10%	5250

002195	二三四五	300	深市退补现金替代	10%	3669
002202	金风科技	500	深市退补现金替代	10%	8550
002230	科大讯飞	300	深市退补现金替代	10%	10581
002236	大华股份	500	深市退补现金替代	10%	8100
002241	歌尔股份	300	深市退补现金替代	10%	10158
002252	上海莱士	300	深市退补现金替代	10%	5874
002292	奥飞娱乐	200	深市退补现金替代	10%	4192
002299	圣农发展	100	深市必须现金替代		1859
002304	洋河股份	200	深市退补现金替代	10%	17410
002310	东方园林	400	深市退补现金替代	10%	6420
002385	大北农	700	深市退补现金替代	10%	4613
002415	海康威视	600	深市退补现金替代	10%	19476
002424	贵州百灵	100	深市退补现金替代	10%	1835
002426	胜利精密	600	深市必须现金替代		4608
002450	康得新	800	深市退补现金替代	10%	15600
002456	欧菲光	300	深市退补现金替代	10%	11340
002465	海格通信	600	深市退补现金替代	10%	7044
002466	天齐锂业	200	深市退补现金替代	10%	8070
002470	金正大	500	深市退补现金替代	10%	3670
002475	立讯精密	300	深市退补现金替代	10%	7338
002500	山西证券	400	深市退补现金替代	10%	4456
002568	百润股份	100	深市退补现金替代	10%	2227
002594	比亚迪	200	深市退补现金替代	10%	9980
002673	西部证券	500	深市必须现金替代		9465
002714	牧原股份	100	深市退补现金替代	10%	2775
002736	国信证券	800	深市退补现金替代	10%	11936
002739	万达院线	200	深市退补现金替代	10%	11682
002797	第一创业	100	深市退补现金替代	10%	3028
300002	神州泰岳	500	深市退补现金替代	10%	4915

300015	爱尔眼科	100	深市退补现金替代	10%	3065
300017	网宿科技	200	深市退补现金替代	10%	8526
300024	机器人	400	深市退补现金替代	10%	9024
300027	华谊兄弟	600	深市退补现金替代	10%	6048
300033	同花顺	100	深市退补现金替代	10%	6686
300058	蓝色光标	400	深市退补现金替代	10%	3744
300059	东方财富	700	深市退补现金替代	10%	10920
300070	碧水源	600	深市退补现金替代	10%	9972
300072	三聚环保	200	深市退补现金替代	10%	12152
300085	银之杰	100	深市退补现金替代	10%	1974
300104	乐视网	400	深市退补现金替代	10%	12700
300124	汇川技术	300	深市退补现金替代	10%	6666
300133	华策影视	200	深市退补现金替代	10%	2220
300144	宋城演艺	200	深市退补现金替代	10%	3932
300146	汤臣倍健	200	深市退补现金替代	10%	2246
300168	万达信息	200	深市退补现金替代	10%	3480
300182	捷成股份	300	深市退补现金替代	10%	2991
300251	光线传媒	300	深市退补现金替代	10%	2865
300315	掌趣科技	600	深市必须现金替代		5304
600000	浦发银行	2900	允许	10%	
600008	首创股份	800	允许	10%	
600009	上海机场	300	允许	10%	
600010	宝钢股份	3200	允许	10%	
600015	华夏银行	1800	允许	10%	
600016	民生银行	7900	允许	10%	
600018	上港集团	1100	允许	10%	
600019	宝钢股份	2900	允许	10%	
600021	上海电力	300	允许	10%	
600023	浙能电力	1400	允许	10%	

600028	中国石化	3500	允许	10%	
600029	南方航空	1200	允许	10%	
600030	中信证券	2600	允许	10%	
600031	三一重工	1300	允许	10%	
600036	招商银行	3400	允许	10%	
600037	歌华有线	200	允许	10%	
600038	中直股份	100	允许	10%	
600048	保利地产	2400	允许	10%	
600050	中国联通	2800	允许	10%	
600060	海信电器	300	允许	10%	
600061	国投安信	400	允许	10%	
600066	宇通客车	400	允许	10%	
600068	葛洲坝	900	允许	10%	
600074	保千里	300	允许	10%	
600085	同仁堂	200	允许	10%	
600089	特变电工	1100	允许	10%	
600100	同方股份	600	允许	10%	
600104	上汽集团	1200	允许	10%	
600109	国金证券	700	允许	10%	
600111	北方稀土	700	允许	10%	
600115	东方航空	1000	允许	10%	
600118	中国卫星	200	允许	10%	
600150	中国船舶	200	允许	10%	
600153	建发股份	600	允许	10%	
600157	永泰能源	1700	允许	10%	
600170	上海建工	1200	允许	10%	
600177	雅戈尔	500	允许	10%	
600188	兖州煤业	100	允许	10%	
600196	复星医药	300	允许	10%	

600208	新湖中宝	1100	允许	10%	
600221	海南航空	2200	允许	10%	
600252	中恒集团	900	允许	10%	
600256	广汇能源	1000	允许	10%	
600271	航天信息	400	允许	10%	
600276	恒瑞医药	500	允许	10%	
600297	广汇汽车	500	允许	10%	
600309	万华化学	400	允许	10%	
600332	白云山	200	允许	10%	
600340	华夏幸福	300	允许	10%	
600352	浙江龙盛	800	允许	10%	
600362	江西铜业	300	允许	10%	
600369	西南证券	900	允许	10%	
600372	中航电子	200	允许	10%	
600373	中文传媒	200	允许	10%	
600376	首开股份	300	允许	10%	
600383	金地集团	700	允许	10%	
600406	国电南瑞	500	沪市必须被替代		8315
600415	小商品城	900	允许	10%	
600446	金证股份	200	允许	10%	
600482	中国动力	100	允许	10%	
600485	信威集团	500	沪市必须被替代		7300
600489	中金黄金	600	允许	10%	
600498	烽火通信	200	沪市必须被替代		5122
600518	康美药业	1000	允许	10%	
600519	贵州茅台	200	允许	10%	
600535	天士力	200	允许	10%	
600547	山东黄金	200	允许	10%	
600549	厦门钨业	100	沪市必须被替代		2279

600570	恒生电子	200	允许	10%	
600582	天地科技	500	允许	10%	
600583	海油工程	700	允许	10%	
600585	海螺水泥	700	允许	10%	
600588	用友网络	200	允许	10%	
600606	绿地控股	800	允许	10%	
600637	东方明珠	400	允许	10%	
600648	外高桥	100	允许	10%	
600649	城投控股	400	沪市必须被替代		8136
600654	中安消	300	沪市必须被替代		5229
600660	福耀玻璃	500	允许	10%	
600663	陆家嘴	200	允许	10%	
600666	奥瑞德	200	允许	10%	
600674	川投能源	700	允许	10%	
600685	中船防务	100	允许	10%	
600688	上海石化	700	允许	10%	
600690	青岛海尔	1000	允许	10%	
600703	三安光电	700	允许	10%	
600704	物产中大	400	允许	10%	
600705	中航资本	1500	允许	10%	
600718	东软集团	300	允许	10%	
600737	中粮糖业	300	允许	10%	
600739	辽宁成大	400	允许	10%	
600741	华域汽车	400	允许	10%	
600754	锦江股份	100	沪市必须被替代		2957
600783	鲁信创投	100	允许	10%	
600795	国电电力	3900	允许	10%	
600804	鹏博士	400	允许	10%	
600816	安信信托	600	允许	10%	

600820	隧道股份	600	允许	10%	
600827	百联股份	300	允许	10%	
600837	海通证券	2700	允许	10%	
600839	四川长虹	1200	允许	10%	
600867	通化东宝	300	沪市必须被替代		6417
600871	石化油服	600	允许	10%	
600873	梅花生物	600	允许	10%	
600875	东方电气	400	允许	10%	
600886	国投电力	1400	允许	10%	
600887	伊利股份	2000	允许	10%	
600893	中航动力	300	允许	10%	
600895	张江高科	300	允许	10%	
600900	长江电力	2200	允许	10%	
600958	东方证券	1000	允许	10%	
600959	江苏有线	500	允许	10%	
600999	招商证券	800	允许	10%	
601006	大秦铁路	2000	允许	10%	
601009	南京银行	1200	允许	10%	
601018	宁波港	1300	允许	10%	
601021	春秋航空	100	允许	10%	
601088	中国神华	700	允许	10%	
601099	太平洋	2300	允许	10%	
601111	中国国航	700	允许	10%	
601118	海南橡胶	400	允许	10%	
601127	小康股份	100	沪市必须被替代		2557
601155	新城控股	300	允许	10%	
601166	兴业银行	4400	允许	10%	
601169	北京银行	4000	允许	10%	
601186	中国铁建	1500	允许	10%	

601198	东兴证券	400	允许	10%	
601211	国泰君安	1500	允许	10%	
601216	君正集团	800	允许	10%	
601225	陕西煤业	700	允许	10%	
601258	庞大集团	1600	允许	10%	
601288	农业银行	12700	允许	10%	
601318	中国平安	3600	允许	10%	
601328	交通银行	9100	允许	10%	
601333	广深铁路	1100	允许	10%	
601336	新华保险	300	允许	10%	
601377	兴业证券	1600	允许	10%	
601390	中国中铁	2500	允许	10%	
601398	工商银行	7200	允许	10%	
601555	东吴证券	700	允许	10%	
601600	中国铝业	2200	允许	10%	
601601	中国太保	1000	允许	10%	
601607	上海医药	400	允许	10%	
601608	中信重工	400	允许	10%	
601611	中国核建	200	允许	10%	
601618	中国中冶	1800	允许	10%	
601628	中国人寿	600	允许	10%	
601633	长城汽车	400	允许	10%	
601668	中国建筑	5000	允许	10%	
601669	中国电建	1400	允许	10%	
601688	华泰证券	1100	允许	10%	
601718	际华集团	500	允许	10%	
601727	上海电气	1000	沪市必须被替代		8420
601766	中国中车	3200	允许	10%	
601788	光大证券	600	允许	10%	



601800	中国交建	500	允许	10%	
601818	光大银行	5300	允许	10%	
601857	中国石油	1600	允许	10%	
601866	中远海发	1100	允许	10%	
601872	招商轮船	700	允许	10%	
601877	正泰电器	100	允许	10%	
601888	中国国旅	200	允许	10%	
601899	紫金矿业	3700	允许	10%	
601901	方正证券	1400	允许	10%	
601919	中远海控	1300	允许	10%	
601928	凤凰传媒	300	允许	10%	
601933	永辉超市	1300	允许	10%	
601939	建设银行	2200	允许	10%	
601958	金铂股份	300	允许	10%	
601985	中国核电	1600	允许	10%	
601988	中国银行	7000	允许	10%	
601989	中国重工	3100	允许	10%	
601998	中信银行	1000	允许	10%	
603000	人民网	200	允许	10%	
603885	吉祥航空	100	允许	10%	
603993	洛阳钼业	1300	允许	10%	

#### （八）拒绝或暂停接受申购

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：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、因特殊原因（包括但不限于相关证券、期货交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 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，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。

7、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购、赎回清单。

8、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购上限，当一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申购超过申购赎回清单中规定的申购上限时，该笔申购申请将被拒绝。

9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值并暂停申购。

10、法律法规规定、上海证券交易所或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 4、8 项以外暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### （九）暂停赎回的情形

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：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、因特殊原因（包括但不限于相关证券、期货交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4、证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。

5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购、赎回清单。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格

且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值并暂停赎回。

7、法律法规规定、上海证券交易所或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付，在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### （十一）其他

1、其他申购赎回方式

1)、在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

2)、ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出联接基金，在本基金上市之前，联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

3)、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

4)、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

5)、对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前

另行公告。

6)、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

### 2、基金的转托管、非交易过户、冻结及解冻等其他业务

登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

### 3、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。

### （二）投资范围

本基金主要投资于沪深300指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以在履行适当程序后，参与融资和转融通证券出借业务。

本基金投资于沪深300指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标，是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，以便更好地实现基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金参与中小企业私募债投资时，对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

本基金参与资产支持证券投资时，将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### （四）投资组合管理

正常情况下，本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会认定的特殊情形除外。

正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按目标指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用优化方法作为完全复制法的补充，

以更好达到复制指数的目标。

### 1、投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金管理人根据对成份股基本面趋势和流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

### 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购、赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理策略

#### （1）每季度进行基金收益评估

基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上，方可

对超额收益部分进行分配；

本基金将根据基金收益评估的结果和支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行现金支付的准备。

#### （2）每月进行基金费用支付

每月末，本基金将根据基金合同中基金管理费、基金托管费、指数许可使用费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

#### （3）成份股更新

当成份股发生更新时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，并依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### （4）定期投资组合监控

每周末，数量分析师对本基金的运作情况进行量化评估，提交评估报告；

每季末，基金经理团队将根据评估报告，向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报，季报将对以下问题进行分析和说明：

对该季的投资操作、基金组合状况以及跟踪误差进行基本陈述，并重点对出现较大跟踪偏离的情况予以说明；

现金控制情况；

成份股更新期的策略；

成份股未来变化预测等。

投资决策委员会将根据本基金的投资运作季报，对下一阶段的投资操作提出建议和指导。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### （五）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值



的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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%，本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%；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（5）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（6）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%；

（7）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不

得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（11）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（12）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（13）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（14）本基金持有单只企业中期票据，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（15）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（16）本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）本基金投资于非上市交易的股票、债券及不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

（20）法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他投资限制。

除上述第（7）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述第（17）项所

规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

若将来法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## （六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即沪深 300 指数收益率。

沪深 300 指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深 300 的价格指数。若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在指定媒介上公告。

### （七）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的相似的风险收益特征。

### （八）基金管理人代表基金行使股东和债权人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和债权人权利，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）投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日，本财务数据未经审计。

## 1.1 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	5,201,278,010.85	99.42
	其中：股票	5,201,278,010.85	99.42
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	28,141,852.52	0.54
8	其他资产	2,281,894.50	0.04
9	合计	5,231,701,757.87	100.00

投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的。

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	16,964,547.60	0.33
B	采矿业	168,337,298.05	3.23
C	制造业	2,103,552,329.19	40.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	129,193,260.58	2.48
E	建筑业	177,061,063.08	3.40
F	批发和零售业	82,889,576.92	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	160,486,694.81	3.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,931,161.45	3.94
J	金融业	1,780,202,432.46	34.19
K	房地产业	255,540,340.93	4.91
L	租赁和商务服务业	60,371,187.44	1.16
M	科学研究和技术服务业	4,128,080.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	12,373,048.60	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,930,253.42	0.56
R	文化、体育和娱乐业	16,316,736.32	0.31
S	综合	-	-
	合计	5,201,278,010.85	99.90

### 1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 1.3 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

### 1.3.1 报告期末指数投资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	4,664,568	359,638,192.80	6.91
2	600519	贵州茅台	216,202	184,634,345.98	3.55
3	600036	招商银行	4,442,235	150,680,611.20	2.89
4	000651	格力电器	2,073,516	97,890,690.36	1.88
5	601166	兴业银行	5,371,879	97,607,041.43	1.87
6	000333	美的集团	1,997,898	97,357,569.54	1.87
7	600030	中信证券	3,386,400	83,914,992.00	1.61
8	000858	五粮液	836,100	79,429,500.00	1.53
9	600887	伊利股份	2,618,982	76,238,566.02	1.46
10	600276	恒瑞医药	1,141,258	74,661,098.36	1.43

### 1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 1.4 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。

**1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**1.7 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投资。

**1.8 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。

**1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1906	IF1906	3	3,483,720.00	125,820.00	-
公允价值变动总额合计（元）					125,820.00
股指期货投资本期收益（元）					988,932.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					436,968.00

**1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

**1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****1.10.1 本期国债期货投资政策**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 1.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 1.11 投资组合报告附注

### 1.11.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行，于2018年2月12日被中国银监会处罚，主要违法违规事实包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行，于2018年4月19日被银保监会处罚，主要违法违规事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。



**1.11.2**

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**1.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	459,749.61
2	应收证券清算款	779,919.42
3	应收股利	-
4	应收利息	4,029.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	289,473.70
8	其他	748,722.62
9	合计	2,281,894.50

**1.11.4 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。

**1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

**1.11.6 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，分项之和与合计可能有尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

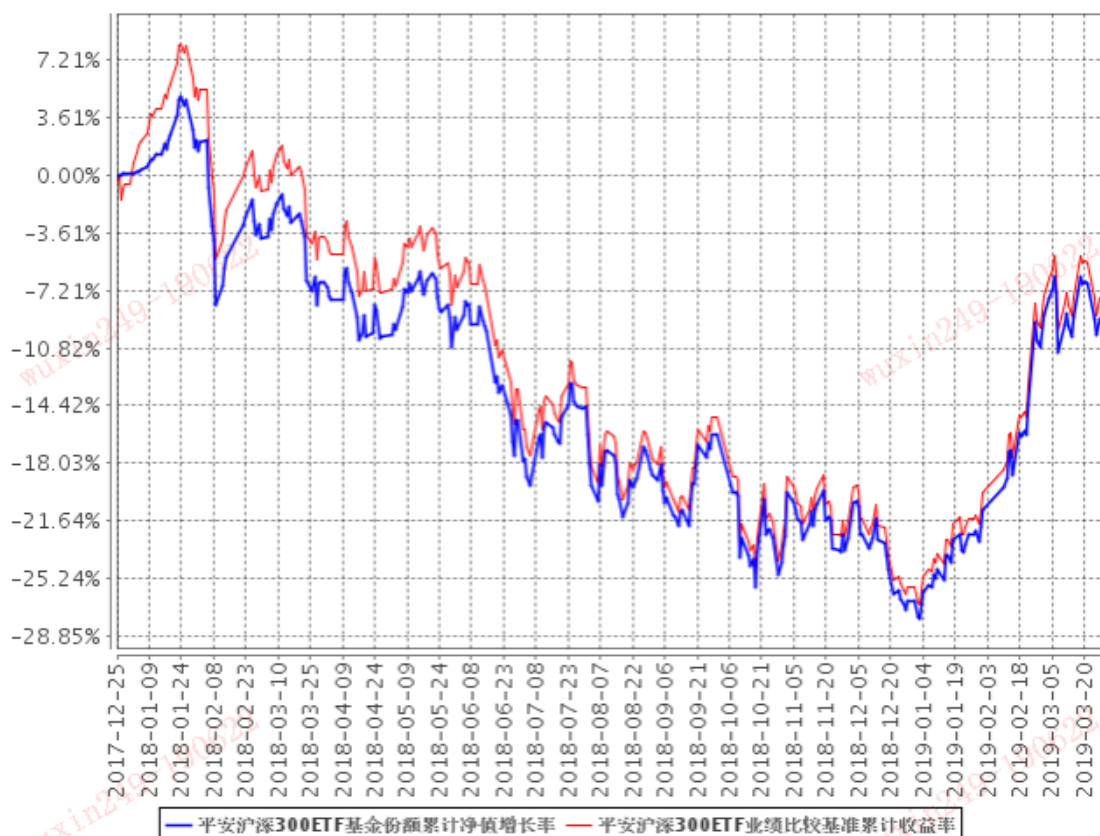
一、自基金合同生效以来（2017年12月25日）至2019年3月31日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017.12.25-2017.12.31	0.09%	0.01%	-0.59%	0.78%	0.68%	-0.77%
2018.1.1-2018.6.30	-15.46%	1.13%	-12.90%	1.16%	-2.56%	-0.03%
2018.7.1-2018.12.31	-13.35%	1.50%	-14.25%	1.50%	0.90%	0.00%
2019.1.1-2019.3.31	28.38%	1.55%	28.62%	1.55%	-0.24%	0.00%
自合同成立以来	-5.87%	1.38%	-4.50%	1.39%	-1.37%	-0.01%

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率

## 二、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安沪深300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2017年12月25日正式生效，截至报告期末已满一年；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 十三、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记结算机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十四、基金资产的估值

### （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交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价作为估值全价；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活

跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、中小企业私募债券，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。

5、本基金投资期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、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。

7、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。

8、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。

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，按照基金管理人根据基金资产净值的计算结果对外予以公布

#### （四）估值程序

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

从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

### （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。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，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、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

#### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；

由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误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，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。

但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”),则估值错误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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记结算机构交易数据的,由基金登记结算机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(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,并报中国证监会备案。

(3) 因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

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。

## (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;



- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

在上述第 3 项情形下，基金管理人还应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

### （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和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按约定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 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数公司及登记结算机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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或减轻由此造成的影响。

## 十五、基金收益与分配

### （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。

### （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）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人可进行收益分配；

2、在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配4次。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

3、本基金的收益分配均采用现金分红的方式；

4、《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配原则进行调整，并及时公告。

### （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基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、支付方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（六）基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；；
- 9、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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前 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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

### 3、标的指数许可使用费

基金标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，经基金托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式的，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前在指定媒介上刊登公告。

4、上述“（一）基金费用的种类”中除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **（四）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十七、基金的信息披露

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

### （二）信息披露义务人

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。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人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。

（四）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。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

（1）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

## 4、基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后，在基金份额上市交易前或开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个交易/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。

基金管理人应当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。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，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媒介上。

## 5、基金份额申购、赎回对价

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



## 6、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

## 7、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应至少提前两个工作日将基金份额折算日公告登载于指定媒介上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于指定媒介上。

## 8、申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

## 9、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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媒介上。

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媒介上。

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。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

## 10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- （1）基金份额持有人大会的召开；
- （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百分之五十；
- （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百分之三十；
- （11）涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- （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、标的指数许可使用费等费用计提标准、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百分之零点五；
- （18）基金改聘会计师事务所；
- （19）变更基金销售机构；
- （20）更换基金登记结算机构；

- (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) 本基金变更标的指数；
- (24) 本基金停复牌或终止上市；；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 本基金调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- (27) 本基金推出新业务或服务
- (28) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- (29) 中国证监会规定的其他事项。

#### 11、澄清公告

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

#### 12、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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。

#### 13、投资于股指期货的信息

基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### 14、投资资产支持证券的信息

基金管理人应在基金季度报告中披露持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

基金管理人应在基金年报及半年报中披露持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

### 15、参与融资及转融通证券出借交易的信息

基金管理人应在基金季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

### 16、投资中小企业私募债券的信息

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

### 17、中国证监会规定的其他信息。

#### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回清单、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十九、风险揭示

本基金主要面临的风险有：

### （一）市场风险

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

（1）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险。随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。基金投资于上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（4）购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### （二）管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

（1）决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

（2）操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

（3）技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

（三）职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

（四）合规性风险：指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

### （五）本基金特定风险

#### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### （2）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

#### （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3）标的指数成份股派发现金红利将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### （4）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （5）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### （6）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### （7）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### （8）投资者申购失败的风险

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商如发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

#### （9）投资者赎回失败的风险

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### （10）基金赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。



### （11）套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和ETF存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

### （12）申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。

### （13）二级市场流动性风险

对ETF基金而言，二级市场流动性风险是指由于相关成份股的市场流动性不足使基金无法以合理价格买入或卖出所需股份数量所造成的风险。流动性风险主要发生在基金建仓期以及标的指数调整成份股期间。

对ETF基金投资人而言，ETF可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

（14）第三方机构服务的风险本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

1）申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

2）登记结算机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3）第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

### （15）退补现金替代方式的风险

本基金在申购赎回环节包括“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

#### (16) 中小企业私募债的投资风险

本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

#### (17) 资产支持证券的投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### (18) 股指期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

## （六）、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## （七）本基金的流动性风险评估

### （1）本基金的申购、赎回安排

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，其特殊的申购、赎回机制可以支持不同市场情形下投资者的赎回要求。

根据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及本基金基金合同相关约定。本基金在满足上市条件以后，将向上海证券交易所申请基金份额上市，基金份额上市以后，基金份额持有人可以通过二级市场卖出的方式获得流动性，同时，本基金拟将安排做市券商为本基金的二级市场交易提供流动支持。

具体措施可详见基金合同“第七部分 基金份额的上市交易”、“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分以及招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”部分的相关内容。

### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。沪深 300 指数的成份股采用流动性较高的股票，且投资标的规模较大、流动性充足。

本基金投资策略充分考量了成份股流动性不足的市场情形，在基金合同投资策略中约定：“因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。”

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。”

因此，针对特殊流动性不足的情况下，本基金投资策略上也做了相应灵活的安排，以应对流动性风险。

（3）实施备用的流动性风险管理工具的情形，程序及投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

（一）暂停接受赎回申请；

（二）延缓支付赎回款项；

（三）暂停基金估值；

（四）中国证监会认定的其他措施。

具体措施可详见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分的相关内容，以及招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”部分的相关内容。

在特定情形下，因采取上述措施，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期。

#### （八）科创板的投资风险

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票。本基金资产并非必然投资科创板股票。

本基金可投资于科创板股票，除了需要承担与A股类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临科创板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

（1）科创板规则不同带来的风险：科创板股票发行、上市、定价、交易、退市等规则与其他市场板块存在诸多差异，科创板上市企业规模及数量、投资者关注度、股票未来的交易活跃程度等均存在较大的不确定性，以上情形可能增加本基金的投资风险。

（2）科创板上市企业经营风险：科创板市场股票首次公开发行并上市的条件

与主板、创业板和中小板市场存在较大差异，允许存在未弥补亏损、未盈利企业上市，科创板上市企业与其他科技创新企业相比，除了同样面临商业模式较新、技术失败或经营失败的风险外，盈利风险以及业绩波动风险可能更大。

（3）科创板上市企业退市风险：如科创板上市企业不满足届时适用的上市条件，则面临退市的风险，届时本基金持有的退市科创板股票面临无法在公开市场卖出，且无法转到其他市场进行公开交易或者转让的风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

（4）科创板股票的流动性风险：科创板对投资者设定了门槛，股票成交量及交易活跃度存在较大不确定性，可能存在股票交易流动性不足的风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

（5）科创板股票价格波动风险：一方面科创板上市企业集中在科技创新型企业，本身股票价格波动风险可能要大，科创板股票可能出现因公司基本面变化、异常交易情形等原因引起股价较大波动。此外，科创板股票单日涨跌幅度可能更大，科创板股票受到特殊事件影响可能表现出更为剧烈的股价波动，由此增加本基金净值的波动风险。

### （九）其他风险

（1）随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险。

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

（7）其他意外导致的风险。

### （九）声明

1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金管理人指定的销售代理机构销售，基金管理人与销售代理机构都不能保证其收益或本金安全。

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 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

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；



（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、份额转让等的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）依法募集资金，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）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）编制并公告申购赎回清单，计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购对价、赎回对价；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价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、足额支付赎回对价；

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

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

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

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

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

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

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

（23）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

（25）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；

（26）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（27）建立并保存基金份额持有人名册；

（28）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但

不限于：

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

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

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守基金合同；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价、赎回对价及法律法规和基金合同所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （8）返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- （9）提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时地更新和补充，并保证其真实性；
- （10）法律法规及基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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拥有平等的投票权。

若以本基金为目标 ETF 且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

#### （一）召开事由

1、除法律法规，或基金合同，或中国证监会另有规定外，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）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；

- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- （11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （12）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）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；
- （13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （14）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违背法律法规和基金合同约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、在对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下调低赎回费率或变更收费方式；
- （4）因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （5）对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或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （6）基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则；
- （7）标的指数更名或调整指数编制方法，以及在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更业绩比较基准；根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费费率和计算方法；
- （8）在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

（9）在不违反法律法规的情况下，本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

（10）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 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（含 10%）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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

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



（三）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、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（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；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记结算机构记录相符。

3、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、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人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拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

###### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集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选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新

清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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。

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

（九）对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### （一）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配；

2、在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次。本基

金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

- 3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；
- 4、《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配原则进行调整，并及时公告。

#### （二）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基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、支付方式等内容。

#### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### （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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；

- 8、基金的上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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前 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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

### 3、标的指数许可使用费

基金标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，经基金托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式的，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前在指定媒介上刊登公告。

4、上述“（一）基金费用的种类”中除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

### （二）投资范围



本基金主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以在履行适当程序后，参与融资和转融通证券出借业务。

本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

为有效管理投资组合，本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标，是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，以便更好地实现基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用

股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金参与中小企业私募债投资时，对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

本基金参与资产支持证券投资时，将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### （四）投资组合管理

正常情况下，本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会认定的特殊情形除外。

正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按目标指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用优化方法作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。

##### 1、投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金管理人根据对成份股基本面趋势和流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

## 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购、赎回清单并公告。

## 3、定期投资组合管理策略

### （1）每季度进行基金收益评估

基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上，方可对超额收益部分进行分配；

本基金将根据基金收益评估的结果和支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行现金支付的准备。

### （2）每月进行基金费用支付

每月末，本基金将根据基金合同中基金管理费、基金托管费、指数许可使用费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

### （3）成份股更新

当成份股发生更新时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，并依

据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### （4）定期投资组合监控

每周末，数量分析师对本基金的运作情况进行量化评估，提交评估报告；

每季末，基金经理团队将根据评估报告，向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报，季报将对以下问题进行分析和说明：

对该季的投资操作、基金组合状况以及跟踪误差进行基本陈述，并重点对出现较大跟踪偏离的情况予以说明；

现金控制情况；

成份股更新期的策略；

成份股未来变化预测等。

投资决策委员会将根据本基金的投资运作季报，对下一阶段的投资操作提出建议和指导。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （五）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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%，本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%；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（5）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（6）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%；

（7）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（11）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（12）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（13）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（14）本基金持有单只企业中期票据，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（15）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（16）本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）本基金投资于非上市交易的股票、债券及不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

（20）法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他投资限制。

除上述第（7）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述第（17）项所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

若将来法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （二）基金资产净值的公告方式

基金合同生效后，在基金份额上市交易前或开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个交易/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。

基金管理人应当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。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，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媒介上。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；



(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 八、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。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。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

基金合同受中国法律管辖。

#### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅，但应以基金合同的正本为准。

## 二十二、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：平安基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

法定代表人：罗春风

成立时间：2011 年 1 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】1917 号

注册资本：人民币 130,000 万元

组织形式：有限责任公司（中外合资）

经营范围：发起设立基金、基金管理及相关中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：0755-22624581

传真：0755-23998639

联系人：张平

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：洪渊

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### I.基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资和转融通证券出借业务。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（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：

本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

（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：

1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

2) 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%，本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%；

3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

5) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

6) 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%；

7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资

产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

10) 本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

a. 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

c. 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

d. 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

e. 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

11) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

12) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

13) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

14) 本基金持有单只企业中期票据，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

15) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

16) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债

券等；

18) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

19) 基金投资于非上市交易的股票、债券及不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；

20) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同规定的其他投资限制。

除上述第（7）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述第（17）项所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

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，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；

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

4、根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与其有控股关系的股东、与其有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

5、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，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。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以 DVP(券款兑付)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交易方式进行交易时，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，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基



金托管人不承担责任。

（3）基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

#### 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，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。基金投资流通受限证券，还应遵守《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）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(3) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应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中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(4) 基金托管人应按照《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》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。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。

II.基金托管人应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。

III.基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，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。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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。

### （三）基金管理人有关基金托管人的业务核查

基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于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等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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、无故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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应立即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。

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。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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。

#### （四）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。

（3）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。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，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托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将网下现金认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的平安基金管理有限公司基金认购专户。网下股票认购结束，登记结算机构应根据基金管理人提供的资料对募集的股票进行冻结。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金

托管人在收到资金当日出具确认文件。网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。

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、股票解冻事宜。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

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

### 5、债券托管账户的开立和管理

(1)《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场债券回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

### 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、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的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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或保管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应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

### （五）基金资产净值的计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值及基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可

的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

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

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。基金份额登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、每年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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年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。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，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。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经

友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本托管协议受中国法律（为本托管协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### （八）托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，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备案。

##### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有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。



## 二十三、对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺向基金份额持有人提供一系列的服务。同时，基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，对以下主要服务内容进行增加或变更。

### 一、网上开户与交易服务

客户持有指定银行的账户，通过平安基金官网交易平台，可以实现在线开户交易。

平安基金网址：[www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com)

### 二、资料的寄送服务

1、基金管理人在未收到客户关于需要寄送纸质对账单的明确表示下，将发送电子对账单。客户可根据个人需要，通过平安基金客户服务热线或者平安基金客服邮箱定制纸质对账单寄送服务。客户无需额外承担纸质或电子对账单的服务费用

2、如果客户选择纸质对账单，本基金管理人将采用邮寄方式提供资料。但由于非基金管理人可控的原因邮寄资料可能无法送达，对此本基金管理人不做任何承诺和保证。基金管理人也不对因邮寄资料出现遗漏、泄露而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。由于交易对账单记录信息属于个人隐私，请务必预留正确的通讯地址及联系方式，并及时进行更新。

3、电子邮件对账单经互联网传送，可能因邮件服务器解析等问题无法正常显示原发送内容。由于互联网是开放性的公众网络，基金管理人也无法完全保证其安全性与及时性。因此平安基金管理公司不对电子邮件或短信息电子化账单的送达做出承诺和保证，也不对因互联网或通讯等原因造成的信息不完整、泄露等而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

4、根据客户的需求，本基金管理人可提供如资产证明书等其它形式的账户信息资料。

### 三、定期定额投资计划

基金管理人可利用非直销销售机构网点和本公司网上交易系统为投资者提供定期定额投资的服务（本公司网上交易系统的定期定额投资服务目前仅对个人投

投资者开通)。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体实施方法见有关公告。

#### 四、网络在线服务

基金份额持有人通过基金账号/开户证件号码及登录密码登录平安基金网站，可享有账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等多项在线服务。

基金管理人网站亦提供基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息供投资人查询。

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

客服邮箱：[fundservice@pingan.com.cn](mailto:fundservice@pingan.com.cn)

#### 五、客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

客户服务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。

客户服务中心人工座席每个交易日9：00-17：00为投资人提供服务，投资人可以通过该客服中心获得业务咨询、信息查询、投诉建议、信息定制和资料修改等专项服务。

客服电话：400-800-4800（免长途话费）

直销电话：0755-22627627

直销传真：0755-23990088

#### 六、投诉受理

投资人可以拨打平安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，原则上是及时回复，对于不能及时回复的投诉，本基金管理人将在承诺的时限内进行处理。对于非工作日提出的投诉，将在顺延的工作日当日进行处理。

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十四、其他应披露事项

（一）本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

（二）最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2018年12月25日至2019年6月24日发布的公告：

1、2019年1月3日，平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告；

2、2019年1月17日，关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明；

3、2019年1月19日，平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2018年第4季度报告；

4、2019年2月2日，平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2018年第2期）以及摘要；

5、2019年2月12日，平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告；

6、2019年3月27日，平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2018年年度报告以及摘要；

7、2019年4月19日，平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2019年第1季度报告；

8、2019年5月10日，关于旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购赎回代办机构的公告；

（四）《招募说明书》与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本次更新的招募说明书为准。

## 二十五、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定，对2019年2月2日公布的《平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2018年第2期）》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、 根据最新资料，更新了“重要提示”部分。
- 2、 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”。
- 3、 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”。
- 4、 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”。
- 5、 根据最新资料，更新了“十一、基金的投资”。
- 6、 根据最新资料，更新了“十二、基金的业绩”。
- 7、 根据最新资料，更新了“十九、风险揭示”。
- 8、 根据最新资料，更新了“二十四、其他应披露的事项”。
- 9、 根据最新情况，更新了“二十五、对招募说明书更新部分的说明”。

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，投资人可在办公时间查阅；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。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站([www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十七、备查文件

除第(五)项外,以下备查文件存放在基金管理人或基金托管人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。

(一) 中国证监会准予平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

(二) 《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(五) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(六) 关于申请募集注册平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的法律意见

(七) 注册登记协议

(八) 中国证监会要求的其他文件

平安基金管理有限公司

2019年8月7日