

# 易方达中小板指数证券投资基金（LOF）

## 招募说明书

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一九年九月

## 重要提示

易方达中小板指数分级证券投资基金根据 2012 年 5 月 22 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可 [2012] 680 号）和 2012 年 7 月 31 日《关于易方达中小板指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函 [2012] 672 号）的核准，进行募集。《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 20 日正式生效。

易方达中小板指数证券投资基金（LOF）由易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期满后自动转换而来。中国证监会对易方达中小板指数分级证券投资基金募集的核准及转换为本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

易方达中小板指数分级证券投资基金于 2012 年 9 月 20 日起进入七分级运作期。在分级运作期内，易方达中小板指数分级证券投资基金分为易基中小板基础份额、易基中小板 A 类份额和易基中小板 B 类份额三类风险收益特征不同的份额进行运作。上述分级运作期于 2019 年 9 月 19 日到期。

根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期届满，易方达中小板指数分级证券投资基金于 2019 年 9 月 20 日自动转换为上市开放式基金（LOF），其中易基中小板基础份额直接转换为易基中小板份额，易基中小板 A 类份额及易基中小板 B 类份额折算为易基中小板份额，基金名称变更为“易方达中小板指数证券投资基金（LOF）”，转换后场内易基中小板份额将申请在深圳证券交易所上市交易。转换完成后，基金投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等内容将保持不变。

《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基金合同》自 2019 年 9 月 20 日起生效，《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》于同日起失效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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。

场外申购时，投资者通过非直销销售机构网点或本公司网上直销系统首次申购的单笔最低金额为 1000 元人民币，通过本公司直销中心首次申购的单笔最低金额为 50,000 元人民币，追加申购单笔最低金额均为 1,000 元人民币。场内申购时，单笔申购金额最低为 1000 元人民币（以上金额均含申购费）。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素而产生波动。投资有风险，投资者在投资本基金前，敬请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金

的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。

投资本基金可能遇到的风险主要包括：因政治、经济、投资者心理与交易制度等各种因素对证券价格产生影响而形成的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险；因基金份额持有人大量赎回或市场暴跌导致的流动性风险；因本基金运作特点且投资于股指期货而引致的特定风险；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；以及其他意外因素导致的风险等。其中，本基金特定风险包括：(1)与本基金指数化投资方式相关的特定风险，如本基金为保持与业绩比较基准一致的风险收益特征而存在系统性风险；本基金对于无法获取足额数量的股票寻找投资替代品而潜在的投资替代风险；因业绩比较基准变更或投资组合调整导致的标的指数变更风险；以及因基金业绩表现与业绩比较基准产生差异而导致的跟踪偏差风险等；(2)与本基金运作方式相关的特定风险。如易基中小板份额上市交易相关的流动性风险、折溢价风险等；(3)与本基金投资于股指期货相关的特定风险。如因股指期货合约与标的指数波动不一致导致的基差风险以及股指期货合约之间价差异常变动可能导致的展期风险；因股指期货交易采取保证金制度且盯市结算可能导致的盯市结算风险；因所选择的期货经纪商破产清算或违规经营导致的第三方风险等。本基金属于证券投资基金中高预期风险、高预期收益品种。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2019年9月19日，有关财务数据截止日为2019年6月30日，净值表现截止日为2019年6月30日。（本报告中财务数据未经审计）

## 目 录

一、	绪 言.....	1
二、	释 义.....	2
三、	基金管理人.....	7
四、	基金托管人.....	18
五、	相关服务机构.....	22
六、	基金的历史沿革.....	63
七、	基金的存续.....	64
八、	基金份额的上市交易.....	65
九、	基金份额的申购、赎回和转换.....	66
十、	基金的非交易过户、冻结与质押.....	80
十一、	基金份额的登记结算.....	81
十二、	基金的投资.....	82
十三、	基金的业绩.....	92
十四、	基金的财产.....	94
十五、	基金资产估值.....	95
十六、	基金的收益与分配.....	100
十七、	基金的费用与税收.....	102
十八、	基金的会计与审计.....	105
十九、	基金的信息披露.....	106
二十、	风险揭示.....	110
二十一、	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	115
二十二、	基金合同的内容摘要.....	118
二十三、	基金托管协议的内容摘要.....	131
二十四、	对基金份额持有人的服务.....	143
二十五、	其他应披露事项.....	144
二十六、	招募说明书存放及查阅方式.....	146
二十七、	备查文件.....	147

## 一、 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》、《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》”）等有关法律法规以及《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）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,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资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

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

- 基金或本基金：指易方达中小板指数证券投资基金（LOF），由易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来
- 基金合同：指《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充，基金合同由《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》修订而来
- 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充，该托管协议由《易方达中小板指数分级证券投资基金托管协议》修订而来
- 招募说明书或本招募说明书：指《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期的更新
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 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
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《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
- 《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
- 《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
- 《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

《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》及颁布机构对其不时作出的修订
基金管理人:	指易方达基金管理有限公司
基金托管人:	指中国建设银行股份有限公司
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
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为中国证券登记结算有限责任公司,基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构
投资者、基金投资者:	指符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称
个人投资者:	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
机构投资者:	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者:	指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
基金合同当事人:	指受基金合同约定,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
基金份额持有人:	指依基金合同和招募说明书合法取得本基金基金份额的投资者
基金合同生效日:	指《易方达中小板指数证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日,即 2019 年 9 月 20 日,《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效
存续期:	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
日/天:	指公历日
月:	指公历月
工作日、交易日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

《业务规则》：	指易方达基金管理有限公司、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订
场外：	指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所
场内：	指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所
登记结算系统：	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统
证券登记系统：	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统
上市交易：	指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖易基中小板份额的行为
《上市交易公告书》	指《易方达中小板指数证券投资基金(L0F)上市交易公告书》
申购：	指基金合同生效后的存续期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金易基中小板份额的行为
赎回：	指基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将本基金易基中小板份额兑换为现金的行为
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为
系统内转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转登记的行为
跨系统转托管：	基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转登记的行为
定期定额投资计划：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及申购方式，由销售机构于每期约定申购日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式



易基中小板份额： 标的指数：	指易方达中小板指数证券投资基金（LOF）之基金份额 本基金的标的指数为中小板价格指数
巨额赎回：	指本基金单个开放日内的易基中小板份额净赎回申请（赎回 申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购 申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超 过上一开放日基金总份额的 10%
基金销售业务：	指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申 购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业 务
非直销销售机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基 金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议， 办理基金销售业务的机构
直销机构：	指易方达基金管理有限公司
销售机构：	指直销机构和非直销销售机构
基金销售网点：	指直销机构的直销网点及非直销销售机构的销售网点
开放式基金账户：	指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公 司注册的、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份 额余额及其变动情况的账户
基金交易账户：	指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构买 卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
深圳证券账户：	投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的 深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券 投资基金账户
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
交易时间：	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
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 请的工作日
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数
元：	指人民币元
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
基金资产总值：	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款

	项和其他投资所形成的价值总和
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值:	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的单位基金份额的价值, 计算日基金份额总数为计算日易基中小板份额总数
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
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
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
中国:	指中华人民共和国。就本基金招募书而言, 不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
不可抗力:	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素。
流动性受限资产:	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产, 包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款 (含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

### 三、 基金管理人

#### (一) 基金管理人基本情况

1. 基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期：2001年4月17日

法定代表人：刘晓艳

联系电话：400 881 8088

联系人：李红枫

注册资本：12,000万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

2. 股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总计	100%

#### (二) 主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。

现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

周泽群先生，高级管理工商管理硕士（EMBA），董事。曾任珠海粤财实业有限公司董事长；粤财控股（北京）有限公司总经理、董事长；广东粤财投资控股有限公司总经理助理、办公室主任，广东粤财投资控股有限公司副总经理。现任广东粤财投资控股有限公司董事、总经理。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理；广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长；广发控股（香港）有限公司董事。现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理；广发证券资产管理（广东）有限公司董事长；广发控股（香港）有限公司董事长。

陈志辉先生，管理学硕士，董事。曾任美的集团税务总监；安永会计师事务所广州分所高级审计员；盈峰投资控股集团有限公司资财中心总经理。现任宁波盈峰股权投资基金管理有限公司合伙人、联席总裁；深圳市盈峰环保产业基金管理有限公司监事；广东顺德盈峰互联网产业投资管理有限公司监事；广东神华保险代理有限公司董事；厦门瑞为信息技术有限公司董事。

戚思胤先生，经济学硕士，董事。曾任广东省高速公路发展股份有限公司证券部投资者关系管理业务员、投资者关系管理主管、信息披露主管、证券事务代表；广东省广晟资产经营有限公司资本运营部高级主管、团委副书记、副部长、部长；（香港）广晟投资发展有限公司董事、常务副总经理等职务。现任广东省广晟资产经营有限公司董事会办公室（法务中心）主任；广东风华高新科技股份有限公司董事；佛山电器照明股份有限公司董事；深圳市中金岭南有色金属股份有限公司董事；佛山市国星光电股份有限公司董事；广东南粤银行股份有限公司董事。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授；复星旅游文化集团（开曼）有限公司独立董事。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授；中远海运特种运输股份有限公司独立董事；上海莱士血液制品股份有限公司独立董事；珠海华发实业股份有限公司独立董事；广州恒运企业集团股份有限公司独立董事；中国南方航空股份有限公司独立董事；广州环保投资集团有限公司外部董事。

庄伟燕女士，法学博士，独立董事。曾任广东省妇女联合会干部；广东鸿鼎律师事务所

所主任;广东广悦鸿鼎律师事务所管委会主任。现任广东广信君达律师事务所高级合伙人。

陈国祥先生, 经济学硕士, 监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理; 广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理; 易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

赵必伟先生, 经济学专业研究生, 监事。曾任广州市财政局第四分局工作专管员; 广州市税务局对外分局工作科长、副局长; 广州市广永国有资产经营有限公司董事副总裁、总裁; 香港广永财务有限公司副总经理、总经理; 广州市广永经贸公司总经理; 广州银行股份有限公司副董事长; 广州广永丽都酒店有限公司董事。现任广州市广永国有资产经营有限公司董事长、党总支书记; 万联证券股份有限公司董事; 广州赛马娱乐总公司副董事长; 广州银行股份有限公司董事。

廖智先生, 经济学硕士, 监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管; 易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理; 广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生, 工商管理硕士(MBA), 常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理; 广东证券公司发行上市部经理; 深圳证券业务部总经理、基金部总经理; 易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁; 易方达国际控股有限公司董事。

陈彤先生, 经济学博士, 副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员; 易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁; 易方达国际控股有限公司董事。

马骏先生, 高级管理人员工商管理硕士(EMBA), 副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员; 深圳众大投资有限公司投资部副总经理; 广发证券有限责任公司研究员; 易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁; 易方达资产管理(香港)有限公司董事、人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人、证券交易负责人员(R0)、就证券提供意见负责人员(R0)、提供资产管理负责人员(R0)、固定收益投资决策委员会委员、产品审批委员会委员。

吴欣荣先生, 工学硕士, 副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募

基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官。

关秀霞女士，财务硕士、工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析师；Daniel Dennis 高级审计师；美国道富银行波士顿及亚洲总部大中华地区高级副总裁、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计部高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士(EMBA)，首席养老金业务官。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任；浦东发展银行总行企业年金部总经理；长江养老保险公司首席市场总监；易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

陈荣女士，经济学博士，首席运营官。曾任中国人民银行广州分行统计研究处科员；易方达基金管理有限公司运作支持部经理、核算部总经理助理、核算部副总经理、核算部总经理、投资风险管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司首席运营官，兼任公司财务中心主任；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理有限公司监事；易方达海外投资（深圳）有限公司监事。

汪兰英女士，工学学士、法学学士，首席大类资产配置官。曾任中信证券股份有限公司风险投资部投资经理助理；中国证监会基金监管部副主任科员、主任科员、副处长、处长；中国人寿资产管理有限公司风险管理部副总经理(主持工作)、项目评审部副总经理(主持工作)、基金投资部副总经理（主持工作）。现任易方达基金管理有限公司首席大类资产配置官；易方达资产管理有限公司董事。

## 2. 基金经理

成曦先生，经济学硕士。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理、易方达深

证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 4 月 27 日至 2019 年 8 月 15 日）、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 5 月 4 日至 2019 年 8 月 15 日）。现任易方达基金管理有限公司易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）（原易方达中小板指数分级证券投资基金）基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 7 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 5 月 17 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达原油证券投资基金(QDII) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 3 月 13 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2019 年 9 月 6 日起任职）、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 9 月 9 日起任职）。

刘树荣先生，经济学硕士。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起至 2019 年 8 月 15 日）、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起至 2019 年 8 月 15 日）。现任易方达基金管理有限公司易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）（原易方达中小板指数分级证券投资基金）基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达并

购重组指数分级证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 18 日起任职）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）。

本基金历任基金经理情况：王建军先生，管理时间为 2012 年 9 月 20 日至 2016 年 7 月 5 日。

### 3. 投资决策委员会成员

本公司指数投资决策委员会成员包括：林飞先生、张胜记先生、林伟斌先生。

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数与量化投资部总经理、量化基金组合部总经理、指数与量化投资管理总部总经理、指数及增强投资部总经理、量化策略部总经理、量化投资部代总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数管理总部总经理、解决方案部总经理、投资经理，易方达资产管理（香港）有限公司就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、证券交易负责人员（RO）。

张胜记先生，管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深 300 指数证券投资基金）基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数投资部总经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达恒生中国企业



交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)基金经理。

林伟斌先生，经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数投资部副总经理。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### **（三）基金管理人的职责**

1. 依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制季度、半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 按照规定召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 中国证监会规定的其他职责。

### **（四）基金管理人的承诺**

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (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. 本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利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 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；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4. 基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

#### 1. 公司内部控制的总体目标

(1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；

(2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；

(3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；

(4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；

(5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

#### 2. 公司内部控制遵循的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；

(2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(3) 相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡；

(4) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；

(5) 有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

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

#### 3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制

度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### 4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

##### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

##### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

##### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

##### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

##### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系

统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### (6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### (7) 监察与合规管理

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察与合规管理工作的需要和董事会授权，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。

公司设立监察与合规管理总部开展监察与合规管理工作，并保证监察与合规管理总部的独立性和权威性。公司明确了监察与合规管理总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。

监察与合规管理总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与合规管理工作，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。

### 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、 基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管

理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玘，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国

最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

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

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程



(1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、 相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1. 场外销售机构

(1) 直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：刘晓艳

电话：020-85102506

传真：4008818099

联系人：李红枫

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

直销机构网点信息：

1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼

电话：020-85102506

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦18层

电话：010-63213377

传真：400 881 8099

联系人：刘蕾

3) 易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼

电话：021-50476668

传真：400 881 8099

联系人：于楠

4) 易方达基金管理有限公司网上直销系统

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

(2) 非直销销售机构（以下排序不分先后）

1) 中国建设银行

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

联系人：王未雨

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

## 2) 交通银行

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：王菁

联系电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

## 3) 浦发银行

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：赵守良

联系电话：021-61618888

客户服务电话：95528

传真：021-63604196

网址：www.spdb.com.cn

## 4) 招商银行

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：季平伟

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

## 5) 浙商银行

注册地址：浙江杭州市庆春路 288 号

办公地址：浙江杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：沈崑杰

联系电话：0571- 88261822

客户服务电话：95527

传真：0571-87659954

网址：www.czbank.com

6) 中国工商银行

注册地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：杨菲

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

7) 中国民生银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

8) 中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

联系人：李紫钰

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

9) 中国邮政储蓄银行

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：张金良

联系人：王硕

客户服务电话：95580

传真：010-68858057

网址：www.psbc.com

10) 北京银行

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

联系人：韩裕

客户服务电话：95526

传真：010-66226045

网址：www.bankofbeijing.com.cn

11) 东莞农村商业银行

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人：王耀球

联系人：洪晓琳

客户服务电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

12) 东莞银行

注册地址：东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号东莞银行大厦

法定代表人：卢国锋

联系人：朱杰霞

联系电话：0769-22865177

客户服务电话：96228（广东省内）、40011-96228（全国）

网址：www.dongguanbank.cn

13) 杭州银行

注册地址：杭州市下城区庆春路 46 号

办公地址：杭州市下城区庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

联系人：陈振峰

联系电话：0571-85872972

客户服务电话：95398

传真：0571-85106576

网址：www.hzbank.com.cn

14) 河北银行

注册地址：石家庄市平安北大街 28 号

办公地址：石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

联系人：王丽辉

联系电话：0311-67807030

客户服务电话：400-612-9999

传真：0311-67806407

网址：www.hebbank.com

15) 江南农村商业银行

注册地址：常州市和平中路 413 号

办公地址：常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

联系人：李仙

电话：0519-80585939

客户服务电话：0519-96005

传真：0519-89995170

网址：http://www.jnbank.com.cn

16) 宁波银行

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

联系人：施豪迪

客户服务电话：95574

网址：www.nbc.com.cn

17) 泉州银行

注册地址：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

办公地址：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

联系人：董培姗

联系电话：0595-22551071

客户服务电话：400-88-96312

传真：0595-22578871

网址：www.qzccb.com

18) 上海农村商业银行

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号上海农商银行大厦

法定代表人：徐力

联系人：施传荣

联系电话：021-61899999

客户服务电话：021-962999、4006962999

开放式基金业务传真：021-50105124

网址：www.srcb.com

19) 上海银行

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：王笑

联系电话：021-68475732

客户服务电话：95594

网址：<http://www.bosc.cn/>

20) 安信证券

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

客户服务电话：95517

传真：0755-82558355

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

21) 渤海证券

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: 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

联系人: 蔡霆

联系电话: 022-28451991

客户服务电话: 400-651-5988

传真: 022-28451892

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

22) 财达证券

注册地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人: 翟建强

联系人: 李卓颖

联系电话: 0311-66008561

客户服务电话: 95363 (河北省内); 0311-95363 (河北省外)

传真: 0311-66006414

网址: [www.s10000.com](http://www.s10000.com)

23) 财富证券

注册地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址: 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

法定代表人: 刘宛晨

联系人: 郭静

联系电话: 0731-84403347

客户服务电话: 95317

传真: 0731-84403439

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

24) 财通证券

注册地址: 浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201, 501, 502, 1103, 1601-1615, 1701-1716 室

办公地址: 浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心



法定代表人：陆建强

联系人：陶志华

联系电话：0571—87789160

客户服务电话：95336、40086-96336

网址：www.ctsec.com

25) 长城国瑞证券

注册地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼

法定代表人：王勇

联系人：邱震

联系电话：0592-2079259

客户服务电话：400-0099-886

传真：0592-2079602

网址：www.gwgsc.com

26) 长城证券

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦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：曹宏

联系人：梁浩

联系电话：0755-83530715

客户服务电话：400-6666-888

传真：0755-83516199

网址：www.cgws.com

27) 长江证券

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

联系电话：027-65799999

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

28) 川财证券

注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼

办公地址：四川省成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼

法定代表人：孟建军

联系人：匡婷

联系电话：028-86583053

客户服务电话：028-86583000

网址：www.cczq.com

29) 大通证券

注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦

38、39 层

法定代表人：赵玺

联系人：谢立军

联系电话：0411-39991807

客户服务电话：4008-169-169

传真：0411-39673214

网址：www.daton.com.cn

30) 大同证券

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人：董祥

联系人：薛津

联系电话：0351-4130322

客户服务电话：4007121212

传真：0351-7219891

网址：www.dtsbc.com.cn

31) 德邦证券

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 29 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘熠

联系电话：021-68761616

客户服务电话：400-8888-128

传真：021-68767880

网址：<http://www.tebon.com.cn>

### 32) 第一创业证券

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

联系电话：0755-23838750

客户服务电话：95358

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

### 33) 东北证券

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

客户服务电话：95360

传真：0431-85096795

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

### 34) 东方证券

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、

39 层、40 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

传真：021-63326729

网址：<http://www.dfzq.com.cn>

35) 东莞证券

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：陈照星

联系人：李荣

联系电话：0769-22115712

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

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

36) 东海证券

注册地址：江苏省常州市延陵西路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

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531；400-8888-588

传真：021-50498825

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

37) 东吴证券

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

客户服务电话：95330

传真：0512-65588021

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

38) 东兴证券

注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：和志鹏

联系电话：010-66559371

客户服务电话：95309

传真：010-66555133

网址：www.dxzq.net

39) 方正证券

注册地址：长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F

法定代表人：施华

联系人：程博怡

联系电话：010-56437060

客户服务电话：95571

传真：010-56437013

网址：www.foundersc.com

40) 光大证券

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：周健男

联系人：龚俊涛

联系电话：021-22169999

客户服务电话：95525

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

41) 广发证券

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或 02095575

网址：www.gf.com.cn

42) 广州证券

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95396

传真：020-88836654

网址：www.gzs.com.cn

#### 43) 国都证券

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

联系电话：010-84183389

客户服务电话：400-818-8118

传真：010-84183311-3122

网址：www.guodu.com

#### 44) 国海证券

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼

法定代表人：何春梅

联系人：田密

联系电话：0755-83716916

客户服务电话：95563 或 0771-95563

网址：www.ghzq.com.cn

#### 45) 国金证券

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、黎建平

联系电话：028-86690057

客户服务电话：95310

传真：028-86690126

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

46) 国联证券

注册地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号

办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人: 姚志勇

联系人: 祁昊

联系电话: 0510-82831662

客户服务电话: 95570

传真: 0510-82830162

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

47) 国融证券

注册地址: 内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

办公地址: 内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与呈祥路交汇处武川立农村镇银行股份有限公司四楼

法定代表人: 张智河

联系人: 郭一非

联系电话: 010-83991777

客户服务电话: 95385 或 400-660-9839

传真: 010-66412537

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

48) 国盛证券

注册地址: 江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦

法定代表人: 徐丽峰

联系人: 占文驰

联系电话: 0791-86283372

客户服务电话: 956080

传真: 0791-86281305

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

49) 国泰君安证券

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

客户服务电话：95521

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

#### 50) 国信证券

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

#### 51) 国元证券

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：蔡咏

联系人：李蔡

客户服务电话：95578

传真：0551-2272100

网址：www.gyzq.com.cn

#### 52) 海通证券

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553

传真：021-23219100

网址：www.htsec.com

#### 53) 红塔证券



注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

法定代表人：李素明

联系人：罗德

联系电话：0871-63582843

客户服务电话：956060

传真：0871-63578827

网址：<http://www.hongtastock.com>

#### 54) 华安证券

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318

传真：0551-65161672

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

#### 55) 华宝证券

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

联系电话：021-20657517

客户服务电话：400-820-9898

传真：021-20515593

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

#### 56) 华福证券

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18-19 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：021-20655183

客户服务电话：95547

传真：021-20655196

网址：www.hfzq.com.cn

57) 华龙证券

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：陈牧原

联系人：范坤

联系电话：0931-4890208

客户服务电话：95368、400-689-8888

传真：0931-4890628

网址：www.hlzq.com

58) 华融证券

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 至 18 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

联系电话：010-85556048

客户服务电话：95390

传真：010-85556088

网址：www.hrsec.com.cn

59) 华泰证券

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户服务电话：95597

传真：025-83387523

网址：www.htsc.com.cn

60) 华西证券

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

联系电话：010-58124967

客户服务电话：95584

传真：028-86150040

网址：www.hx168.com.cn

#### 61) 华鑫证券

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

联系电话：021-54967552

客户服务电话：95323（全国）、400-109-9918（全国）、029-68918888（西安）

传真：021-54967293

网址：www.cfsc.com.cn

#### 62) 华信证券

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 23 楼

法定代表人：陈灿辉

联系人：徐璐

联系电话：021-63898952

客户服务电话：400-820-5999

传真：021-68776977 转 8952

网址：www.shhxzq.com

#### 63) 江海证券

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：姜志伟

联系电话：0451-87765732

客户服务电话：400-666-2288

传真：0451-82337279

网址：www.jhzq.com.cn

64) 金元证券

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：王作义

联系人：刘萍

联系电话：0755-83025693

客户服务电话：95372

传真：0755-83025625

网址：www.jyzq.cn

65) 九州证券

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：魏先锋

联系人：张思思

联系电话：010-57672272

客户服务电话：95305

传真：010-57672296

网址：www.jzsec.com

66) 联储证券

注册地址：广东省深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号金砖大厦 8 楼

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

联系电话：010-86499427

客户服务电话：400-620-6868

网址：www.lczq.com

67) 联讯证券

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系电话：0755-83331195

客户服务电话：95564

网址：<http://www.lxsec.com>

68) 南京证券

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

联系电话：025-58519523

客户服务电话：95386

传真：025-83369725

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

69) 平安证券

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：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周驰

联系电话：021-38643230

客户服务电话：95511-8

传真：021-58991896

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

70) 山西证券

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

客户服务电话：95573 或 400-666-1618

传真：0351-8686619

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

71) 上海证券

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686888

客户服务电话：4008-918-918

传真：021-53686100、021-53686200

网址：<https://www.shzq.com/>

72) 申万宏源西部证券

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

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

法定代表人：李琦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

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

73) 申万宏源证券

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

联系人：余敏

联系电话：021-33388252

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-33388224

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

74) 世纪证券

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：李强

联系人：王雯

联系电话：0755-83199511

客户服务电话：4008323000

网址：www.csc.com.cn

75) 天风证券

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

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：程晓英

联系电话：027-87617017

客户服务电话：4008005000、95391

传真：027-87618863

网址：<http://www.tfzq.com/>

76) 万联证券

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层

法定代表人：罗钦城

联系人：甘蕾

联系电话：020-38286026

客户服务电话：95322

传真：020-38286588

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

77) 西部证券

注册地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

联系人：梁承华

联系电话：029-87211526

客户服务电话：95582

传真：029-87211478

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

78) 西南证券

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：廖庆轩

联系人：周青

联系电话：023-63786633

客户服务电话：4008096096 或 95355

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

#### 79) 湘财证券

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

联系电话：021-38784580-8918

客户服务电话：95351

传真：021-68865680

网址：www.xcsc.com

#### 80) 新时代证券

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：叶顺德

联系人：田芳芳

联系电话：010-83561146

客户服务电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

#### 81) 信达证券

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：010-63081000

客户服务电话：95321



传真：010-63080978

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

82) 兴业证券

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 20 楼

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

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

83) 银河证券

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

联系电话：010-83574507

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

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

84) 招商证券

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565、400-8888-111

传真：0755-82943636

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

85) 浙商证券

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：高扬

联系电话：057187902974

客户服务电话：95345

传真：0571-87901913

网址：www.stocke.com.cn

#### 86) 中航证券

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

联系电话：15611538682

客户服务电话：95335 或 400-88-95335

传真：010-59562637

网址：www.avicsec.com

#### 87) 中金公司

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

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166

客户服务电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

#### 88) 中山证券

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

#### 89) 中泰证券

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户服务电话：95538

传真：0531-68889095

网址：www.zts.com.cn

#### 90) 中天证券

注册地址：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

联系人：李泓灏

联系电话：024-23255256

客户服务电话：024-95346

传真：024-23255606

网址：www.iztzq.com

#### 91) 中投证券

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82026907

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

#### 92) 中信建投证券

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：权唐

联系电话：010-85130588

客户服务电话：95587 或 4008-888-108

网址: <http://www.csc108.com/>

93) 中信证券

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: 王一通

联系电话: 010-60838888

客户服务电话: 95548

传真: 010-60836029

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

94) 中信证券(山东)

注册地址: 青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人: 姜晓林

联系人: 焦刚

联系电话: 0531-89606166

客户服务电话: 95548

传真: 0532-85022605

网址: <http://sd.citics.com/>

95) 中银国际证券

注册地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层

法定代表人: 宁敏

联系人: 王炜哲

客户服务电话: 400-620-8888

传真: 021-50372474

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

96) 中原证券

注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址: 河南省郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦19楼

法定代表人: 菅明军

联系人: 程月艳 李盼盼 党静

联系电话：0371-69099882

客户服务电话：95377

传真：0371-65585899

网址：www.ccnew.com

97) 长量基金

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

联系电话：021-20691935

客户服务电话：400-820-2899

传真：021-20691861

网址：www.erichfund.com

98) 朝阳永续

注册地址：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法人代表：廖冰

联系人：陆纪青

联系电话：021-80234888-6813

客户服务电话：400-699-1888

网址：www.998fund.com

99) 创金启富

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：李慧慧

联系电话：010-66154828-8047

客户服务电话：400-6262-818

传真：010-63583991

网址：www.5irich.com

100) 大泰金石

注册地址：南京市建邺区江东中路 102 号 708 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：陈达伟

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

客户服务电话：400-995-9220

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

101) 大智慧基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

联系人：张蜓

联系电话：021-20219988-35374

客户服务电话：021-20292031

传真：021-20219923

网址：<https://www.wg.com.cn/>

102) 蛋卷基金

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

联系电话：010-61840688

客户服务电话：4001599288

网址：<https://danjuanapp.com>

103) 泛华普益

注册地址：四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 室

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

联系电话：028-86758820-803

客户服务电话：400-020-0606

网址：www.puyifund.com

104) 富济基金

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

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

105) 海银基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号海银金融中心 4 楼

法定代表人：惠晓川

联系人：毛林

联系电话：021-80133597

客户服务电话：400-808-1016

传真：021-80133413

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

106) 好买基金

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-20613600

客户服务电话：400-700-9665

传真：021-68596916

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

107) 和讯信息

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：陈慧慧

联系电话：010-85657353

客户服务电话：400-920-0022

传真：010-65884788

网址：<http://licaike.hexun.com/>

108) 恒天明泽

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

联系电话：010-59313555

客户服务电话：4008980618

传真：010-59313586

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

109) 弘业期货

注册地址：江苏省南京市秦淮区中华路50号

办公地址：江苏省南京市秦淮区中华路50号弘业大厦9楼

法人代表：周剑秋

联系人：孙朝旺

联系电话：025-52278870

客户服务电话：400-828-1288

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

110) 虹点基金

注册地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门2层216

法定代表人：郑毓栋

联系人：牛亚楠

联系电话：010-65951887

客户服务电话：400-618-0707

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

111) 汇成基金

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼19层19C13



法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

联系电话：01056251471

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

112) 汇付基金

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 汇付天下总部大楼

法定代表人：金佶

联系人：甄宝林

联系电话：021-34013996-3011

客户服务电话：021-34013999

传真：021-33323837

网址：www.hotjijin.com

113) 金观诚

注册地址：杭州拱墅区登云路 45 号金诚集团（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州拱墅区登云路 55 号金诚集团（锦昌大厦）

法定代表人：蒋雪琦

联系人：来舒岚

联系电话：0571-88337888

客户服务电话：4000680058

传真：0571-88337666

网址：<http://www.jincheng-fund.com/>

114) 久富财富

注册地址：上海市浦东新区莱阳路 2819 号 1 幢 109 室

办公地址：上海市浦东新区民生路 1403 号上海信息大厦 1215 室

法定代表人：赵惠蓉

联系人：赵惠蓉

联系电话：021-68682279

客户服务电话：400-102-1813

传真：021-68682297

网址：www.jfcta.com

115) 凯石财富

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：冯强

联系电话：021-63333389

客户服务电话：4006-433-389

传真：021-63333390

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

116) 肯特瑞基金

注册地址：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座

法定代表人：江卉

联系人：韩锦星

联系电话：010-89189291

客户服务电话：95118

网址：<http://fund.jd.com/>

117) 利得基金

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

联系电话：86-021-50583533

客户服务电话：95733

传真：86-21-61101630

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

118) 联泰基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客户服务电话：400-118-1188

传真：021-52975270

网址：www.66zichan.com

119) 陆基金

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

120) 蚂蚁基金

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888

客户服务电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

121) 诺亚正行

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人：汪静波

联系人：余翼飞

联系电话：021-80358749

客户服务电话：400-821-5399

传真：021-38509777

网址：www.noah-fund.com

122) 深圳新兰德

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：洪弘

联系人：张燕

联系电话：010-83363099

客户服务电话：400-166-1188

传真：010-83363010

网址：<http://8.jrj.com.cn>

123) 晟视天下

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

联系人：史俊杰

联系电话：010-58170936

客户服务电话：010-58170761

传真：010-58170800

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

124) 天天基金

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系电话：021-54509977

客户服务电话：95021

传真：021-64385308

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

125) 通华财富

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 楼

法定代表人：沈丹义

联系人：杨涛、庄洁茹

联系电话：021-60810586

客户服务电话：400-101-9301

传真：021-60810695

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

126) 同花顺

注册地址: 浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人: 吴强

联系人: 吴强

联系电话: 0571-88911818

客户服务电话: 4008-773-772

传真: 0571-86800423

网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

127) 万家财富

注册地址: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人: 张军

联系人: 王芳芳

联系电话: 010-59013828

客户服务电话: 010-59013895

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

128) 鑫鼎盛

注册地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1502 室

办公地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1502 室

法定代表人: 陈洪生

联系人: 梁云波

联系电话: 0592-3122757

客户服务电话: 400-918-0808

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

129) 一路财富

注册地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址: 北京市海淀区宝盛南路奥北科技园 20 号楼国泰大厦 9 层

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 刘栋栋

联系电话: 010-88312877

客户服务电话：400-001-1566

传真：010-88312099

网址：www.yilucaifu.com

130) 宜投基金销售

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市福田区嘉里建设广场2座15楼

法定代表人：雷凤潮

联系人：梁菲菲

联系电话：0755-88603874

客户服务电话：4008-955-811

网址：www.yitfund.com

131) 宜信普泽

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼SOHO现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

联系电话：010-52413385

客户服务电话：400-6099-200

传真：010-85800047

网址：www.yixinfund.com

132) 奕丰金融

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

联系电话：0755-89460507

客户服务电话：400-684-0500

传真：0755-21674453

网址：www.ifastps.com.cn

133) 盈米基金

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东路 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系电话：020-89629099

客户服务电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

134) 云湾基金

注册地址：中国上海) 自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、  
103-2 办公区

办公地址：上海市浦东新区新金桥路 27 号 1 号楼

法定代表人：冯轶明

联系人：范泽杰

联系电话：021-20530186

客户服务电话：400-820-1515

传真：021-20539999

网址：<http://www.zhengtongfunds.com/>

135) 增财基金

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

联系人：闫丽敏

联系电话：010-67000988

客户服务电话：400-001-8811

传真：010-67000988-6000

网址：www.zcvc.com.cn

136) 展恒基金

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

联系电话：010-59601366-7167

客户服务电话：400-818-8000

传真：0351-4110714

网址：www.myfund.com

137) 中信建投期货

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B, 名义层 11-A, 8-B4, 9-B、

C

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：王广学

联系人：刘芸

联系电话：023-86769637

客户服务电话：400-8877-780

传真：023-86769629

网址：www.cfc108.com

138) 中信期货

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

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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-6083 3754

客户服务电话：400-990-8826

传真：021-60819988

网址：<http://www.citicsf.com/>

139) 中证金牛

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

联系电话：010-59336544

客户服务电话：4008-909-998



网址: www.jnlc.com

140) 众禄基金

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路HALO广场4楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 龚江江

联系电话: 0755-33227950

客户服务电话: 4006-788-887

传真: 0755-33227951

网址: www.zlfund.cn      www.jjmmw.com

141) 浦领基金

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人: 聂婉君

联系人: 李艳

联系电话: 010-59497361

客户服务电话: 400-012-5899

传真: 010-64788016

网址: www.zscffund.com

2. 场内销售机构

深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位, 具体名单详见深圳证券交易所网站。

**(二) 基金登记结算机构**

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址: 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: 4008058058

传真: (010) 5937 8907

联系人: 赵亦清

**(三) 出具法律意见书的律师事务所**

律师事务所: 上海通力律师事务所

地址：上海浦东新区银城中路 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：安冬、陆奇

联系人：安冬

#### **(四) 审计基金财产的会计师事务所**

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：赵雅、马婧

联系人：赵雅

## 六、 基金的历史沿革

易方达中小板指数证券投资基金（LOF）由易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来。

易方达中小板指数分级证券投资基金于 2012 年 9 月 20 日起进入七年分级运作期。在分级运作期内，易方达中小板指数分级证券投资基金分为易基中小板基础份额、易基中小板 A 类份额和易基中小板 B 类份额三类风险收益特征不同的份额进行运作。上述分级运作期于 2019 年 9 月 19 日到期。

根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期届满，易方达中小板指数分级证券投资基金于 2019 年 9 月 20 日自动转换为上市开放式基金（LOF），其中易基中小板基础份额直接转换为易基中小板份额，易基中小板 A 类份额及易基中小板 B 类份额折算为易基中小板份额，基金名称变更为“易方达中小板指数证券投资基金（LOF）”，转换后场内易基中小板份额在深圳证券交易所上市交易。转换完成后，基金投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等内容将保持不变。

## 七、 基金的存续

本基金根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定由“易方达中小板指数分级证券投资基金”分级运作期届满后自动转换而来。本《基金合同》自 2019 年 9 月 20 日起生效，《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》于同日起失效。

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

## 八、 基金份额的上市交易

### （一）上市交易的基金份额

易基中小板份额

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （三）上市交易的时间

基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定申请本基金的基金份额上市交易。

本基金上市交易后，登记在证券登记系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记系统后，方可上市交易。

### （四）上市交易的规则

本基金上市交易的基金份额在深圳证券交易所上市交易，需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。

### （五）上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

### （六）上市交易的行情揭示

上市基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### （七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 九、 基金份额的申购、赎回和转换

### （一）基金投资者范围

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

### （二）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行，投资者可通过场外或场内两种方式对本基金易基中小板份额进行申购与赎回。

本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外非直销销售机构的销售网点；场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单详见深圳证券交易所网站）。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减场外销售机构，并予以公告。

### （三）申购与赎回的开放日及时间

易方达中小板指数证券投资基金（LOF）于2019年9月20日自易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来，并于2019年9月23日起恢复办理日常申购和赎回业务。

投资者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。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （四）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 场外基金份额持有人在赎回基金份额时，遵循“先进先出”原则，即按照投资者认

购、申购的先后次序进行顺序赎回。认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所使用的赎回费率；

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5. 投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所和登记结算机构的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

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

### **（五）申购与赎回的程序**

#### **1. 申购与赎回的申请方式**

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

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

#### **2. 申购与赎回申请的确认**

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记结算机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，自 T+2 日起（包括该日），投资者应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申请的成交情况。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。

#### **3. 申购与赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的销售机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金管理人将通过相关基金销售机构自接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生巨额赎回情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并进行公告。

### **（六）申购与赎回的数额限制**

#### **1. 申购基金的金额限制**

场外申购时，投资者通过非直销销售机构或本公司网上直销系统首次申购的单笔最低

金额为1000元人民币,通过本公司直销中心首次申购的单笔最低金额为50,000元人民币,追加申购单笔最低金额均为1,000元人民币。在符合法律法规规定的前提下,各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的,需同时遵循该销售机构的相关规定。场内申购时,每笔申购金额最低为1000元人民币(以上金额均含申购费)。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购,对单个投资者累计持有份额不设上限限制。但对于可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形,基金管理人有权按照相关法律法规采取控制措施。当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体请参见相关公告。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

## 2. 赎回的份额限制

基金份额持有人办理场外赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1份基金份额;基金份额持有人办理场内赎回时,每笔赎回申请的最低份额为1份基金份额,同时赎回份额必须是整数份额。

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。基金份额单笔赎回或转换不得少于1份(如该账户在该销售机构托管的该基金余额不足1份,则必须一次性赎回或转出该基金全部份额);若某笔赎回将导致投资者在该销售机构托管的该基金余额不足1份时,基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的该基金剩余份额一次性全部赎回。在符合法律法规规定的前提下,各销售机构对赎回份额限制有其他规定的,需同时遵循该销售机构的相关规定。

3. 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制,或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## (七) 申购、赎回的费率

### 1. 申购费率

本基金对通过本公司直销中心申购易基中小板份额的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的场外申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类



型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人的直销中心申购易基中小板份额的特定投资群体场外申购费率为：

申购金额 M(元) (含申购费)	申购费率
M<100 万	0.12%
100 万≤M<200 万	0.08%
200 万≤M<500 万	0.04%
M≥500 万	按笔固定收取 1,000 元/笔

其他投资者申购易基中小板份额场外申购费率为：

申购金额 M(元) (含申购费)	申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<200 万	0.8%
200 万≤M<500 万	0.4%
M≥500 万	按笔固定收取 1,000 元/笔

易基中小板份额的场内申购费率为 0。

## 2. 赎回费率

易基中小板份额的场内、场外赎回费率不高于 1.5%，且随基金份额持有期限的增加而递减。具体费率如下表所示：

<b>场外赎回费率</b>	<b>持有时间(天)</b>	<b>赎回费率</b>
	0-6	1.5%
	7-364	0.5%
	365-729	0.25%
	730 及以上	0%
<b>场内赎回费率</b>	<b>持有时间(天)</b>	<b>赎回费率</b>
	0-6	1.5%
	7 及以上	0.5%

投资者份额持有时间记录规则以登记结算机构最新业务规则为准，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。

3. 在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

4. 基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申

购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。上述费率如发生变更，基金管理人还应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在指定媒体公告。

5. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

## （八）申购份额、赎回金额的计算方式

### 1. 申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

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

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

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

$$\text{对于 500 万元(含)以上的申购, 净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定申购费金额}$$

对于场内申购，涉及金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担；申购份额的计算采用截位法保留至整数位，小数点以后的部分舍去，不足 1 份额对应的申购资金返还至投资者资金账户。

对于场外申购，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，场外申购涉及金额、份额计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

申购场所	申购金额 (元)	申购费 率	净申购金额 (元)	申购费 用(元)	基金份额净 值(元)	申购份数 (份)
场内	100,000	0	100,000	0	1.1100	90,090
场外（非 特定投资 群体）	50,000	1.20%	49,407.11	592.89	1.0000	49,407.11
	5,000,000	1,000 元	4,999,000	1,000	1.0000	4,999,000
场外（特 定投资群 体）	50,000	0.12%	49,940.07	59.93	1.0000	49,940.07
	5,000,000	1,000 元	4,999,000	1,000	1.0000	4,999,000

其中，因投资者场内申购 100,000 元所获得的份额应保留至整数份，即 90,090 份，整

数位后小数部分对应的申购资金需退还给投资者，具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 90,090 \times 1.1100 = 99,999.90 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 99,999.90 = 0.10 \text{ 元}$$

## 2. 基金赎回金额的计算

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

举例说明：

赎回场所	赎回份额 (份)	基金份额净值 (元)	持有时间 (天)	赎回费率	赎回费用 (元)	赎回金额 (元)
场外	10,000	1.0000	100	0.5%	50	9,950
	10,000	1.0000	500	0.25%	25	9,975
	10,000	1.0000	800	0%	0	10,000
场内	10,000	1.0000	6	1.5%	150	9,850
	10,000	1.0000	100	0.5%	50	9,950

本基金场内和场外赎回时，赎回金额、赎回费用以人民币元为单位，四舍五入，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

3. 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。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。其计算公式为：

$$\text{基金份额净值} = \text{计算日基金资产净值} \div \text{计算日基金总份额}$$

4. 本基金的申购费由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用，不计入基金财产；本基金的赎回费由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，对持有期少于 7 天（不含）的基金份额持有人所收取赎回费全额计入基金财产，对持有期在 7 天以上（含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的 25% 计入基金资产，其余用于支付登记结算费等其他相关手续费。

## （九）申购与赎回的登记结算

1. 本基金申购与赎回的登记结算业务按照登记结算机构的有关规定办理。正常情况下，投资者 T 日申购基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记结算手续，投资者自 T+2 日起（含该日）有权赎回该部分基金份额。

2. 投资者 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记结算手续。

3. 登记结算机构可以在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，

但不得实质影响投资者的合法权益，基金管理人最迟于开始实施前 2 个工作日在指定媒体上公告。

#### **(十) 拒绝或暂停申购的情形**

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间临时停市，导致当日基金资产净值无法计算。
3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 本基金资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记系统无法正常运行。
7. 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。
8. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
9. 当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。
10. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
11. 基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停申购的，申购款项本金将全额退还给投资者。发生上述 1 到 7 项以及第 9 到 11 项拒绝或暂停申购情形，且基金管理人决定拒绝或暂停申购申请时，应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **(十一) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2. 证券交易所交易时间临时停市，导致当日基金资产净值无法计算。

3. 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续两个或两个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

4. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

6. 基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并及时公告。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被确认的赎回申请量占已确认赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。若出现上述第 3 款所约定的情形，对已确认的赎回申请，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金份额的赎回，基金管理人应及时在指定媒体上刊登暂停赎回公告。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，并依照有关规定在指定媒体上公告。

## （十二）巨额赎回的认定及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的易基中小板份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。但对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销，交易所或登记结算机构业务规则变化的，从其最新规定。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期

办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。深圳证券交易所、登记结算机构另有规定的，从其规定。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额10%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。

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

(4) 巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及登记结算机构的有关《业务规则》办理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

## (十三) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2. 如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告。

3. 如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告。

4. 如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告。

## (十四) 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

### 1. 基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。

场外转换、申购或跨系统转托管至场外的易基中小板份额登记在登记结算系统持有人开放式基金账户下；场内转换、申购或跨系统转托管至场内的易基中小板份额或上市交易

买入的易基中小板份额登记在证券登记系统持有人证券账户下。登记在证券登记系统中的易基中小板份额既可上市交易，也可以直接申请场内赎回；登记在登记结算系统中的易基中小板份额可申请场外赎回，也可跨系统转托管至证券登记系统后在深圳证券交易所上市交易。

## 2. 系统内转托管

(1) 系统内转托管是指持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回或上市交易的会员单位时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

## 3. 跨系统转托管

跨系统转托管是指持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照登记结算机构及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构或登记结算机构有权对办理转托管业务收取相关费用。

## (十五) 基金转换

### 1、基金转换开始日及时间

易方达中小板指数证券投资基金(LOF)于2019年9月20日自易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来，并于2019年9月23日起恢复办理本基金场外份额的转换业务。

转换业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，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转换时除外。若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 2、基金转换的原则

(1) 基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构销售的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构注册登记的基金。

(2) 基金转换以份额为单位进行申请。投资者可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

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

(4) 基金转换后，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

(5) 投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

(6) 转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即份额注册日期在前的先转换出，份额注册日期在后的后转换出。

(7) 转入本基金的份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

### 3、基金转换的程序

#### (1) 基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

提交基金转换申请时，账户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### (2) 基金转换申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效基金转换申请的当天作为基金转换的申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日前(含T+1日)对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### 4、基金转换的数额限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换成另一只基金，本基金的场外份额单笔转出申请不得少于1份(如该账户在该销售机构托管的该基金场外份额余额不足1份，则必须一次性赎回或转出该基金全部场外份额);若某笔转换导致投资者在该销售机构托管的该基金场外份额余额不足1份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金场外份额剩余份额一次性全部赎回。

### 5、基金转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用按照各基金的基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基



金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

#### 6、基金转换份额的计算方式

$$A=[B\times C\times(1-D)/(1+G)]/E$$

$$H=B\times C\times D$$

$$J=[B\times C\times(1-D)/(1+G)]\times G$$

其中，A为转入的基金份额；B为转出的基金份额；C为转换申请当日转出基金的基金份额净值；D为转出基金的对应赎回费率；E为转换申请当日转入基金的基金份额净值；G为对应的申购补差费率；H为转出基金赎回费；J为申购补差费。

说明：

(1) 基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

(2) 转入基金时，从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时，每次收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时，不收取申购补差费用（注：对通过直销中心申购实施差别申购费率的特定投资群体基金份额的申购费，以除通过直销中心申购的特定投资群体之外的其他投资者申购费为比较标准）。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率的差异情况而定并见相关公告。

(3) 转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费按照各基金的基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(4) 投资者可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

例：假设某持有人（非特定投资群体）在场外持有本基金10,000份，持有90天，现欲转换为易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金A类场外份额；假设转出基金T日的基金份额净值为1.1000元，转入基金易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金A类份额T日的基金份额净值为1.0200元，则转出基金的赎回费率为0.50%，申购补差费率为0.00%。转换份额计算如下：

$$\text{转换金额}=\text{转出基金申请份额}\times\text{转出基金份额净值}=10,000\times 1.1000=11,000.00\text{元}$$

$$\text{转出基金赎回费}=\text{转换金额}\times\text{转出基金赎回费率}=11,000.00\times 0.50\%=55\text{元}$$

$$\begin{aligned}\text{申购补差费}&=(\text{转换金额}-\text{转出基金赎回费})\times\text{申购补差费率}\div(1+\text{申购补差费率})= \\ &=(11,000.00-55)\times 0.00\%\div(1+0.00\%)=0\text{元}\end{aligned}$$

转换费=转出基金赎回费+申购补差费=55+0=55 元

转入金额=转换金额-转换费=11,000.00-55 =10,945 元

转入份额=转入金额÷转入基金份额净值=10,945÷1.0200=10,730.39 份

注：本基金场外份额转出至易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金（LOF）场外份额、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）场外份额、易方达岁丰添利债券型证券投资基金（LOF）场外份额、易方达并购重组指数分级证券投资基金场外基础份额、易方达生物科技指数分级证券投资基金场外基础份额和易方达银行指数分级证券投资基金场外基础份额时，转入份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### 7、基金转换的注册登记

投资者 T 日申请基金转换成功后，注册登记机构将在 T+1 工作日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续，一般情况下，投资者自 T+2 工作日起（含该日）有权赎回转入部分的基金份额。

#### 8、基金转换与巨额赎回

若本基金单个开放日内的基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认（除另有公告外）；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

#### 9、拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的转换申请。
- (2) 证券交易所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) 本基金资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受转换转入可能会影响或损害其他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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- (6) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记系统无法正常运行。
- (7) 基金管理人认为接受某笔或某些转换申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。

(8)基金管理人接受某笔或者某些转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

(9)当一笔新的转换转入申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

(10)当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金转换申请的措施。

(11)因市场剧烈波动或其他原因而出现连续两个或两个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

(12)基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

基金转换业务的解释权归基金管理人，基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律法规和《基金合同》的规定之前提下调整上述转换的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制，但应在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## **(十六) 定期定额投资计划**

易方达中小板指数证券投资基金(LOF)于 2019 年 9 月 20 日自易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来，并于 2019 年 9 月 23 日起恢复办理定期定额投资业务。

如遇法律法规及登记结算机构、证券交易所相关规则等发生变动，上述(十四)、(十五)和(十六)项规则等可相应进行调整。

## 十、 基金的非交易过户、冻结与质押

### （一）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

登记结算机构只受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及登记结算机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和本基金基金合同规定的持有本基金基金份额的条件。

办理非交易过户业务必须提供登记结算机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的规定办理，并按登记结算机构规定的标准收费。

### （二）基金的冻结和解冻

登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记结算机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求，以及登记结算机构业务规定来决定是否冻结。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 十一、 基金份额的登记结算

(一) 本基金的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。

(二) 本基金的登记结算业务由中国证券登记结算有限责任公司负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记结算业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在登记结算业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。

(三) 登记结算机构享有如下权利：

1. 建立和管理投资者基金账户；
2. 取得登记结算费；
3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
4. 在法律法规允许的范围内，制定和调整登记结算业务的相关规则；
5. 法律法规规定的其他权利。

(四) 登记结算机构承担如下义务：

1. 配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
2. 严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的登记结算业务；
3. 保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上；
4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
5. 按基金合同和招募说明书规定为投资者办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；
6. 接受基金管理人的监督；
7. 法律法规规定的其他义务。

## 十二、 基金的投资

### （一）投资目标

本基金采取指数化投资方式，以实现对业绩比较基准的紧密跟踪，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。

### （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含一级市场初次发行及增发的新股，以及在创业板上市的股票）、权证等权益类品种、国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种（含货币市场工具）、股指期货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。

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。

基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的比例为 90%-95%。其中，本基金投资于中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%。

### （三）投资理念

指数化投资具有成本低廉、管理透明和风险分散的特点，投资者可通过指数化投资获取标的市场平均收益。中小板价格指数成份股具有高成长、高流动性的特点，是国内中小企业中最具增长前景的上市公司的代表。通过指数化方式投资于中小型企业，可在有效分散非系统性风险的前提下，以较低成本分享国内中小型企业上市公司的增长成果。

### （四）投资策略

#### 1. 资产配置策略

本基金的投资比例范围为，股票资产占基金资产的比例为 90%-95%。其中，本基金投资于中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。

本基金力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内。

## 2. 权益类品种投资策略

### 2.1 股票投资策略

本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照中小板价格指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当以下情况发生时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪：

- (1) 基金管理人预期指数成份股或权重发生变化；
- (2) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；
- (3) 基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

### 2.2 股票组合的动态调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整：

(1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整；

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

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

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

(5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

2.3 权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

## 3. 股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，进行股指期货投资。具体而言，本基金将运用股指期货进行如下投资：

### (1) 市场风险管理

为达到与业绩比较基准相同的市场暴露度，若本基金投资组合中股票组合的市场暴露度小于业绩比较基准的市场暴露，本基金可通过买入股指期货以实现与业绩比较基准相同的市场暴露度。

### (2) 流动性风险管理

出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。如出现大量净申购，本基金可买入数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的

要求，并在净申购资金到账后逐步平仓；反之，如出现大量净赎回，本基金可卖空数量匹配的股指期货合约以满足权益类资产配置比例的要求，并在卖出股票的同时逐步平仓。此外，如预期出现大量净赎回，本基金可在逐步卖出股票的同时买入数量匹配的股指期货合约以维持目标市场暴露度，并在投资者赎回的同时逐步平仓。

### （五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：

中小板价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

中小板价格指数由深圳证券信息有限公司编制，由 100 家具有代表性的中小板公司组成，用于综合反映中国证券市场中小企业板的整体表现。本基金以中小板价格指数为标的指数，股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，故采用加权复合的方法构建上述业绩比较基准。

若指数编制单位变更或停止中小板价格指数的编制、发布及维护，或指数名称发生变更，或中小板价格指数由其他指数替代，或中小板价格指数因编制方法发生重大变更而不适合继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告。

### （六）风险收益特征

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### （七）投资决策依据

1. 法律、法规和《基金合同》的规定；
2. 标的指数的编制方法及其调整公告等；
3. 对证券市场发展趋势的研究与判断。

### （八）投资决策流程

1. 基金经理拟定资产配置计划，按照制度提交审议并实施；
2. 基金经理依据指数成份股名单及权重，进行投资组合构建；
3. 投资风险管理部定期对投资组合与业绩比较基准的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估；
4. 基金经理根据指数成份股或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股派息情况等，参考有关研究报告及投资风险管理部的评估结果，实时调整投资组合。
5. 股指期货的投资决策流程
  - (1) 基金经理提交股指期货投资申请，经审批后方可进行投资；



(2) 基金经理应在其权限范围内进行股指期货投资。

## (九) 投资禁止行为与限制

### 1. 投资禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

### 2. 投资组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。

本基金投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (3) 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；
- (4) 本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%。其中，本基金投资中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
- (5) 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%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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；

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

(11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(12) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(13) 本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：

① 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的 10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的 20%。

② 在任何交易日日终，本基金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)占基金资产的比例范围为 90%-95%。

④ 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%。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所的要求向其报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

(14) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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

(17) 本基金在任何交易日日终，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。

(18) 基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%。

(19) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

3. 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制修改或取消，如适用于本基金，则本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

### **(十) 投资组合比例调整**

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。除上述组合限制（9）、（10）、（14）、（15）、（16）以外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

### **(十一) 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。

### **(十二) 基金的融资、转融通**

在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资及转融通证券出借业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### **1. 融资策略**

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，参与融资业务。

#### **2. 转融通证券出借策略**

本基金可根据风险管理的原则，参与转融通证券出借交易。转融通证券出借策略按照分散化投资原则，分批、分期进行转融通证券出借交易，以分散风险。

### (十三) 基金投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2019 年 4 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

#### 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	757,951,884.92	93.98
	其中：股票	757,951,884.92	93.98
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	46,983,097.83	5.83
7	其他资产	1,609,632.02	0.20
8	合计	806,544,614.77	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,905,227.80	2.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	456,235,224.68	56.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,444,698.00	0.30
E	建筑业	12,535,280.70	1.56

F	批发和零售业	23,805,326.12	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	17,922,384.64	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,854,082.35	11.55
J	金融业	69,044,089.60	8.59
K	房地产业	7,264,376.31	0.90
L	租赁和商务服务业	32,157,732.92	4.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,315,339.00	0.54
Q	卫生和社会工作	11,415,192.80	1.42
R	文化、体育和娱乐业	6,052,930.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	757,951,884.92	94.26

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	002415	海康威视	1,568,711	43,265,049.38	5.38
2	002304	洋河股份	248,417	30,197,570.52	3.76
3	002475	立讯精密	1,088,979	26,995,789.41	3.36
4	002027	分众传媒	4,815,848	25,475,835.92	3.17
5	002142	宁波银行	1,047,663	25,395,351.12	3.16
6	002230	科大讯飞	703,885	23,397,137.40	2.91
7	002594	比亚迪	370,148	18,773,906.56	2.33
8	002024	苏宁易购	1,537,094	17,645,839.12	2.19
9	002714	牧原股份	292,020	17,167,855.80	2.13
10	002202	金风科技	1,171,290	14,559,134.70	1.81

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

(1) 2018年12月13日，宁波银监局针对宁波银行个人贷款资金违规流入房市、购买理财的违法违规事实，处以人民币20万元的行政处罚。

2019年3月3日，宁波银保监局针对宁波银行违规将同业存款变为一般性存款的违法违规事实，处以人民币20万元的行政处罚。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除宁波银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	198,936.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,355.90
5	应收申购款	1,402,339.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,609,632.02

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 十三、 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同生效日为 2012 年 9 月 20 日，基金合同生效以来（截至 2019 年 6 月 30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率标准差 (2)	业绩比较基准收益率 (3)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
自基金合同生效日至 2012 年 12 月 31 日	0.96%	1.05%	-1.51%	1.36%	2.47%	-0.31%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	14.86%	1.44%	16.78%	1.46%	-1.92%	-0.02%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	8.03%	1.19%	9.28%	1.20%	-1.25%	-0.01%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	32.59%	2.71%	51.12%	2.58%	-18.53%	0.13%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-21.19%	1.83%	-21.72%	1.70%	0.53%	0.13%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	17.61%	0.88%	15.91%	0.87%	1.70%	0.01%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-35.18%	1.56%	-36.15%	1.51%	0.97%	0.05%



2019年1月1日至2019年6月30日	19.19%	1.72%	19.74%	1.73%	-0.55%	-0.01%
自基金合同生效日至2019年6月30日	18.95%	1.68%	31.76%	1.64%	-12.81%	0.04%

注：根据《易方达中小板指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期届满，易方达中小板指数分级证券投资基金于2019年9月20日自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“易方达中小板指数证券投资基金(LOF)”，转换完成后，基金投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等内容将保持不变。修订后的《易方达中小板指数证券投资基金(LOF)基金合同》自2019年9月20日起生效。

## 十四、 基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项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负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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）基金财产的保管及处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和销售机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人、登记结算机构和基金销售机构以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

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

## 十五、 基金资产估值

### （一） 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。本基金基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （二） 估值日

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

### （三） 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四） 估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的股票、权证等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值。估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且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了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值。

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

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

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

#### 2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值价格估值。

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值价格估值；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. 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定

公允价值。

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

5. 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。

6. 股指期货合约按照估值当日的结算价进行估值。估值当日无结算价，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。

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。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核基金管理人计算的基金资产净值。本基金的会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的结果予以公布。

## （五）估值程序

1. 基金份额净值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易基中小板份额的基金资产净值及基金份额净值，并按规定及基金合同的约定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核。基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## （六）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值；
4. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估

值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的；

5. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### **（七）基金份额净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值、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工作日交易结束后计算当日的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，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

### **（八）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)发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同当事人应按照以下约定处理：

#### **1. 差错类型**

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

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

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

#### **2. 差错处理原则**

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

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法,需要修改登记结算机构交易数据的,由登记结算机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

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

(2) 错误偏差达到或超过基金资产净值的 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;错误偏差达到或超过基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并同时报中国证监会备案。

(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。

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

理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。

### **(九) 特殊情形的处理**

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

## 十六、 基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）收益与分配

#### 1. 收益分配原则

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10% ；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统中的基金份额，基金份额持有人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；红利再投资的计算方法等有关事项遵循登记结算机构的相关规定；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统中的基金份额只能采取现金分红方式，基金份额持有人不能选择红利再投资；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 2. 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的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 3. 收益分配方案的确定与公告

(1) 基金收益分配方案由基金管理人拟订，并由基金托管人复核后，基金管理人按法律法规的规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

(2) 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(3) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 4. 收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行汇划费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，登记结算机构可将基金份额持有人的现金



红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

## 十七、 基金的费用与税收

### (一) 与基金运作相关的费用

#### 1. 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) 基金资产的资金汇划费用；
- (4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (7) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (8) 证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- (9) 基金上市初费和上市月费；
- (10) 基金的指数使用许可费；
- (11) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.22%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托

管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

### (3) 基金的指数使用许可费

本基金为股票指数基金,需根据与深圳证券信息有限公司所签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费自基金合同生效日起计提,计算方法如下:

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

H 为每日应付的指数使用许可费

E 为本基金前一日基金资产净值

指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元,即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于每一季度结束后且收到深圳证券信息有限公司有效商业发票后的 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

若指数使用许可费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

(4) 本条第 1 款第(3)至第(9)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

### 3. 不列入基金费用的项目

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

### 4. 基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在至少一家指定媒体上刊登公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1. 申购与赎回费率

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”中“(七)申购、赎回的费率”和“(八)申购份额、赎回金额的计算方式”中的相关规定。

## 2. 转换费率

基金转换费用由投资者承担，基金转换费用由转出基金赎回费用和基金申购补差费用构成，其中转出基金赎回费按照各基金的基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

3. 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整上述费率或收费方式。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率或收费方式实施前在指定媒体及基金管理人网站公告。

4. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

## （三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

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

### （二）基金的审计

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

## 十九、 基金的信息披露

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

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

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### (一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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各自公司网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

### (二) 上市交易公告书

基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将《上市交易公告书》登载在指定媒体上。

### (三) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

在开始办理易基中小板份额的申购或赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通

过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的易基中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### **(四) 基金份额申购、赎回价格公告**

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

#### **(五) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告**

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

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

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

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

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

**(六) 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，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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。**

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

#### **(八) 临时报告与公告**

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

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式(基金合同另有约定,或法律法规、中国证监会另有规定的除外)；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14. 重大关联交易事项；
15. 基金收益分配事项；
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 基金变更、增加或减少销售机构；
20. 基金更换登记结算机构；
21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金易基中小板份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 基金推出新业务或新服务；
27. 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时；
28. 中国证监会或基金合同规定的其他事项。

## (九) 澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金



份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### **（十）基金份额持有人大会决议**

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

#### **（十一）中国证监会规定的其他信息**

#### **（十二）信息披露文件的存放与查阅**

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

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

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十、 风险揭示

基金业绩受证券、期货市场价格波动的影响，投资者持有本基金可能盈利，也可能亏损。本基金主要投资于中小板价格指数成份股及其备选成份股，同时适度参与债券及股指期货投资。本基金面临的风险主要有以下方面：

### （一）市场风险

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

1. 政策风险。因货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，可能导致市场证券市场价格波动，进而影响基金收益。

2. 经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，随着宏观经济运行的周期性变化，证券、期货市场的收益水平也呈周期性变化，本基金所投资各类资产的收益水平也会随之变化。

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

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

5. 购买力风险。基金份额持有人投资于证券所获收益将主要通过现金形式来分配，若发生通货膨胀，现金的购买力可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6. 国际竞争风险。随着对外开放程度的不断提高，我国上市公司在发展过程中必将面临来自国际市场上具有同类技术、提供同类产品的企业的激烈竞争，部分上市公司可能会由于这种竞争而导致业绩下滑，造成其股票价格下跌，从而影响本基金的收益水平。

7. 信用风险。信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化。

### （二）管理风险

1. 在基金资产运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占优以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金资产收益水平；

2. 基金管理人与基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益

水平。

### （三）流动性风险

#### 1. 流动性风险评估

本基金为股票指数基金，主要投资于中小板价格指数成份股及其备选成份股，同时适度参与债券及股指期货投资，一般情况下，这些资产市场流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况。因此，本基金投资于上述资产时，可能存在以下流动性风险：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于特定投资标的的流动性相对不足而无法按预期的价格买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金被迫以不适当的价格卖出股票、债券或其他资产。两者均可能使基金净值受到不利影响。

#### 2. 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回；此外，如因市场剧烈波动或其他原因而出现连续两个或两个以上开放日巨额赎回，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项；当本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理。具体情形、程序见招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”之“(十二) 巨额赎回的认定及处理方式。”

发生上述情形时，投资人面临无法全部赎回或无法及时获得赎回资金的风险。在本基金暂停或延期办理投资者赎回申请的情况下，投资者未能赎回的基金份额还将面临净值波动的风险。

#### 3. 除巨额赎回情形外实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

除巨额赎回情形外，本基金备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值以及证监会认定的其他措施。

暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项等工具的情形、程序见招募说明书“九、基金份额的申购、赎回和转换”之“(十一) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关规定。若本基金暂停赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。若本基金延缓支付赎回款项，赎回款支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

短期赎回费适用于持续持有期少于 7 日的投资者，费率为 1.5%。短期赎回费由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，并全额计入基金财产。短期赎回费的收取将使得投资者在持续持有期限少于 7 日时会承担较高的赎回费。

暂停基金估值的情形、程序见招募说明书“十五、基金资产估值”之“(六) 暂停估

值的情形”的相关规定。若本基金暂停基金估值，一方面投资者将无法知晓本基金的基金份额净值，另一方面基金将暂停接受申购赎回申请或延缓支付赎回款项，将导致投资者无法申购或赎回本基金，或赎回款支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

#### （四）本基金的特定风险

##### 1. 指数投资风险

本基金为股票指数基金，投资标的为中小板价格指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

##### （1）系统性风险

本基金为股票基金，重点投资于中小板价格指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临中小板价格指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

##### （2）投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

##### （3）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

##### （4）跟踪偏差风险

跟踪偏差风险是指本基金在跟踪业绩比较基准时，由于各种原因导致基金的业绩表现与业绩比较基准表现之间产生差异的不确定性，主要影响因素可能包括：

① 基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费、托管费及指数使用许可费等；

② 指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

③ 当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

④ 基金发生申购或赎回:本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票、或在面临投资者赎回时无法将股票及时地转化为现金,这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险

⑤ 在指数化投资过程中,管理人对指数基金的管理能力,如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度;

⑥ 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;因缺乏低成本的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

#### (5) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

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

### 2. 与基金运作方式相关的特有风险

#### (1) 与上市交易相关的流动性风险

在满足上市条件的情况下,本基金易基中小板份额将在深圳证券交易所挂牌上市。在存续期内,如因不满足上市条件、终止上市或按相关业务规则暂停交易而不能在二级市场交易,或因缺少交易对手方而不能以合理的价格转让或变现,将发生流动性风险。

#### (2) 折溢价交易风险

折溢价是指基金价格相对于净值的偏离。因受市场供求关系变动的影 响,易基中小板份额的交易价格与其基金份额净值也可能出现偏离而形成折溢价交易风险。尽管投资者可通过申购基金份额卖出或买入基金份额赎回的方式进行折溢价套利,但套利机制并不能完全消除折溢价。

### 3. 投资于股指期货可能引致的特定风险

#### (1) 基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中,基金资产可能因为所持有股指期货合约与标的指数价格波动方向不一致而承受基差风险。因存在基差风险,在进行股指期货合约展期的过程中,基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

#### (2) 盯市结算风险

股指期货采取保证金交易制度,保证金账户实行当日无负债结算制度,对资金管理要求较高。如出现极端行情,市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足,又未能在规定的时间内补足,按规定期货保证金账户将被强制平仓,从而导致超出预期的损失。

#### (3) 交易对手风险

### ① 对手方风险

基金管理人运用基金资产投资于股指期货，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝因所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。另外，基金管理人在银行间市场进行交易，也会因为银行间交易对手违约等发生对手方风险。

### ② 连带风险

为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

### （五）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

本基金法律文件中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基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同；此外，销售机构也可能根据市场及基金运作情况调整本基金风险等级评价。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，并应随时关注销售机构对于本计划风险等级评介的调整情况，谨慎作为投资决策。

### （六）其他风险

1. 因技术因素而产生的风险，如电脑等技术系统的故障或差错产生的风险；
2. 因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金托管人、基金销售机构等机构无法正常工作，从而影响基金运作的风险；
3. 因金融市场危机、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身控制能力的因素出现，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损的风险。
4. 因固定收益类金融工具主要在场外市场进行交易，场外市场交易现阶段自动化程度较场内市场低，本基金在投资运作过程中可能面临操作风险。

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

(1) 转换基金运作方式。但基金合同另有约定，或法律法规、中国证监会另有规定的除外；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

(1) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

(2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(3) 基金推出新业务或服务；

(4) 基金管理人、登记结算机构、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、转换、非交易过户、转托管业务的规则；

(5) 标的指数更名或调整指数编制方法；

(6) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(7) 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；

(8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

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

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6

个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情形。

### **(三) 基金财产的清算**

#### **1. 基金财产清算组**

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

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

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

#### **2. 基金财产清算程序**

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

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

#### **3. 清算费用**

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

#### **4. 基金财产按下列顺序清偿：**

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；



(3)清偿基金债务；

基金财产未按前款(1)-(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

基金财产在清偿上述第(1)-(3)项后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5. 基金财产清算的公告

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

6. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十二、 基金合同的内容摘要

### (一) 基金管理人的权利与义务

#### 1. 基金管理人的权利

- (1) 自本基金合同生效日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
- (3) 发售基金份额;
- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- (5) 在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
- (7) 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
- (8) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
- (9) 自行担任或选择、更换登记结算机构,获取基金份额持有人名册,并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查;
- (10) 选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
- (11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- (12) 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
- (13) 依法召集基金份额持有人大会;
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 2. 基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- (2) 办理基金备案手续;
- (3) 自基金合同生效日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的

基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7)依法接受基金托管人的监督；

(8)计算并公告基金资产净值，确定基金份额的申购、赎回价格；

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

(10)按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12)编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

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

(17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

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

(22)按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

(24)执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25)不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

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

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

### 1. 基金托管人的权利

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

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效日起，依法保管基金资产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

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

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 2. 基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

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

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人的权利与义务**

#### 1. 基金份额持有人的权利

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

每份易基中小板份额具有同等的合法权益。

#### 2. 基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会**

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

每一基金份额享有平等的投票权。

##### 2. 召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有易基中小板份额 10%以上的基金份额持有人提议时，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止基金合同；

2) 转换基金运作方式，但本基金合同另有约定，或法律法规、中国证监会另有规定的除外；

3) 变更基金类别；

4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

5) 变更基金份额持有人大会程序；

6) 更换基金管理人、基金托管人；

7) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

8) 本基金与其他基金的合并；

9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

1) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

3) 基金推出新业务或服务；

4) 基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、转换、非交易过户、转托管业务的规则；

5) 标的指数更名或调整指数编制方法；

- 6)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
- 7)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;
- 8)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

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

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

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

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

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

### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- 1)会议召开的时间、地点和出席方式;
- 2)会议拟审议的主要事项;
- 3)会议形式;
- 4)议事程序;
- 5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;

6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

7) 表决方式;

8) 会务常设联系人姓名、电话;

9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

10) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

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

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

###### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

① 有效的易基中小板份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%, 下同);

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

###### 2) 通讯开会方式



在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- ①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
  - ②召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；
  - ③召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；
  - ④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的易基中小板份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；
  - ⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与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、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 6. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

- 1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。
- 2) 基金管理人、基金托管人、代表易基中小板份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

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

- 4) 代表易基中小板份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决

的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

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

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

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

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

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

### 2) 通讯方式开会

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

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效。本基金存续期内，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的易基中小板份额基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换

基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 8. 计票

### (1) 现场开会

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

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 通讯方式开会

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

## 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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

出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体上公告。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。

10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### **(五) 基金合同的终止**

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

### **(六) 基金财产的清算**

#### **1. 基金财产清算组**

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

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

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

#### **2. 基金财产清算程序**

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

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；

- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

基金财产在清偿上述第(1)–(3)项后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5. 基金财产清算的公告

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

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## (七) 争议的处理

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

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

本基金合同受中国法律管辖。

## (八) 基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查

阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

## 二十三、 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1. 基金管理人(或简称“管理人”)

名称：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广东省广州市珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

邮政编码：510620

法定代表人：刘晓艳

成立日期：2001年4月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12,000万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

#### 2. 基金托管人(或简称“托管人”)

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

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

### (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对

象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围及投资比例为：

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含一级市场初次发行及增发的新股，以及在创业板上市的股票）、权证等权益类品种、国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种（含货币市场工具）、股指期货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。

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。

基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的比例为 90%-95%。其中，本基金投资于中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

(1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(2) 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%；

(3) 本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%。其中，本基金投资中小板价格指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(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) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基



金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(9) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(10) 本基金投资流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%；因流通受限证券价格波动、基金规模变动、新股申购等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券并在流通受限期结束后卖出流通受限证券；

(11) 本基金投资股指期货，还应包括以下投资监督比例：

1) 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的 10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的 20%。

2) 在任何交易日日终，本基金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）占基金资产的比例范围为 90%-95%。

4) 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%。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

(12) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

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，则本基金投资不再受相关限制。

除上述(7)、(8)、(12)、(13)、(14)以外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符

合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止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本机构有控股关系的股东、与本机构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。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人与基金托管人完成确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受

限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1) 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因基金管理人原因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人负责应对本基金投资受限证券的流动性风险，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应按照法律法规和基金合同的规定处理并承担相应责任。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险且基金托管人已尽职监督核查的，基金托管人不承担任何责任。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定

媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

3) 有关比例限制的执行情况。

4) 信息披露情况。

(6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、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。

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

8. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### **(三) 基金管理人对基金托管人的业务核查**

1. 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金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。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一个工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### **(四) 基金财产保管**

##### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

(5) 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，如基金托管人无法从公开信息或基金管理人提供的书面资料中获取到账日期信息的，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## 2. 基金募集期间及募集资金的验资

易方达中小板指数证券投资基金（LOF）由易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满后自动转换而来。

易方达中小板指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2012年5月22日证监许可[2012]680号文核准募集。易方达中小板指数分级证券投资基金于2012年8月20日起向全社会公开募集，并于2012年9月20日获得中国证监会书面确认，基金合同生效。具体募集情况如下：

(1) 经安永华明会计师事务所验资，本次募集有效认购总户数为2501户，净认购金额人民币401,025,502.53元，确认份额（不含利息结转份额）401,025,502.53份，利息结转份额69,225.16份，总确认份额401,094,727.69份，其中场外认购的基金份额确认为265,738,816.69份（含场外募集期利息结转的份额），场内认购确认为135,355,911份（含场内募集期利息结转的份额）。上述本基金的净缴存金额已于2012年9月20日划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的资产托管专户。

(2) 本基金将投资者在场内认购的全部易方达中小板指数分级证券投资基金（135,355,911份（含场内募集期利息结转的份额））按1:1的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即易方达中小板指数分级A和易方达中小板指数分级B。

## 3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

## 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

用由基金管理人负责。

(4) 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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 账户注销时，在遵守中国证券登记结算公司的相关规定下，由管理人和托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

(6) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5. 债券托管专户的开设和管理

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；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6. 其他账户的开立和管理

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

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金

管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

## （五）基金资产净值计算与复核

### 1. 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### （1）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额总数计算，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，经基金托管人复核，按规定公告。

#### （2）复核程序

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

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

### 3. 基金份额净值错误的处理方式

（1）当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金资产净值的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；错误偏差达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通告基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

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

2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管



人未对计算过程提出书面疑义或要求基金管理人出具书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

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

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

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

## **（六）基金份额持有人名册的保管**

基金份额持有人名册至少应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登记结算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分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。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。

## **（七）适用法律与争议解决方式**

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

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

本协议受中国法律管辖。

## **（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，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。

### **2. 基金托管协议终止出现的情形**

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

## 二十四、 对基金份额持有人的服务

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

### （一）场外的基金份额持有人投资交易确认服务

基金登记结算机构保留基金份额持有人名册上列明的场外的基金份额持有人的基金交易记录。

基金管理人直销网点应根据在基金管理人直销网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。基金非直销销售机构应根据在销售网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。

### （二）场外的基金份额持有人交易记录查询服务

场外的基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）场外的基金份额持有人的对账单服务形式

1. 场外基金份额持有人可登录本公司网站(<http://www.efunds.com.cn>)查阅对账单。
2. 场外基金份额持有人也可向本公司定制纸质、电子或短信形式的定期或不定期对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

### （四）资讯服务

#### 1. 客户服务电话

投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，或反馈投资过程中需要投诉与建议的情况，可拨打如下电话：400 881 8088（免长途话费）。投资者如果认为自己不能准确理解本基金《招募说明书》、《基金合同》的具体内容，也可拨打上述电话详询。

#### 2. 互联网站及电子信箱

网址：<http://www.efunds.com.cn>

电子信箱：[service@efunds.com.cn](mailto:service@efunds.com.cn)

## 二十五、 其他应披露事项

公告事项	披露日期
易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	2019-03-27
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购及大额转换转入业务的公告	2019-04-08
易方达基金管理有限公司关于民族证券并入方正证券期间基金业务安排的提示性公告	2019-05-22
易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	2019-05-28
易方达中小板指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	2019-06-10
易方达基金管理有限公司关于调整转换业务货币市场基金未付收益支付规则的公告	2019-06-20
易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	2019-06-22
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金调整大额申购及大额转换转入业务数额限制的公告	2019-06-29
关于易方达中小板指数分级证券投资基金在非直销销售机构调整大额申购及大额转换转入业务数额限制的公告	2019-07-26
易方达基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2019-08-14
易方达基金管理有限公司关于暂停深圳宜投基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2019-08-14
易方达基金管理有限公司关于暂停厦门市鑫鼎盛控股有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2019-08-14
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换及特别风险揭示的公告	2019-08-19
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的公告	2019-08-19
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换及特别风险揭示的第一次提示性公告	2019-08-20
易方达基金管理有限公司关于易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换及特别风险揭示的第二次提示性公告	2019-08-27
关于易方达中小板指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的提示性公告	2019-09-11
关于易方达中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满基金名称变更与到期份额折算基准日等事项的公告	2019-09-17
关于易方达中小板指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的提示性公告	2019-09-17
关于易方达中小板指数分级证券投资基金之中小 A 份额、中小 B 份额终止上	2019-09-17

市的公告	
关于易方达中小板指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管及份额配对转换业务的提示性公告	2019-09-18
关于易方达中小板指数分级证券投资基金之中小 A 份额、中小 B 份额终止上市的提示性公告	2019-09-19

注：以上公告事项披露在指定媒介及基金管理人网站上。

## 二十六、 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十七、 备查文件

1. 中国证监会核准易方达中小板指数分级证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《易方达中小板指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

2019年9月20日