

# 诺安中证 100 指数证券投资基金 招募说明书（更新）

2020 年第 3 期

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

（一）诺安中证 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 2009 年 8 月 28 日证监基金字【2009】864 号文核准公开募集，本基金的基金合同于 2009 年 10 月 27 日正式生效。

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

（三）投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本基金《招募说明书》《基金产品资料概要》及《基金合同》、基金管理人网站公示的《风险说明书》、基金产品风险等级划分方法及说明等，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，须承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场系统性风险、上市公司风险、利率风险、流动性风险、管理风险、本基金特有风险、跟踪误差风险及其他风险等。

本基金属于股票型指数基金，可获取资本市场平均收益率，其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。本基金以一元初始面值募集基金份额，在市场波动等因素的影响下，基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

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

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

（五）基金管理人根据投资者适当性管理办法，对投资者进行分类。投资者应当如实提供个人信息及证明材料，并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。投资者应知晓并确认当个人信息发生重要变化、可能影响投资者分类和适当性匹配的，应及时主动进行更新。

（六）本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息

披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书(更新)已经基金托管人复核，本次招募说明书(更新)依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及《关于实施<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>有关问题的规定》，本招募说明书（更新）所载内容截止日期为 2020 年 11 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

## 目录

第一部分	绪言.....	4
第二部分	释义.....	5
第三部分	基金管理人.....	11
第四部分	基金托管人.....	27
第五部分	相关服务机构.....	32
第六部分	基金份额的分类.....	71
第七部分	基金份额的申购与赎回.....	72
第八部分	基金的投资.....	85
第九部分	基金的业绩.....	96
第十部分	基金的财产.....	98
第十一部分	基金资产的估值.....	100
第十二部分	基金的收益与分配.....	105
第十三部分	基金的费用与税收.....	107
第十四部分	基金的会计与审计.....	110
第十五部分	基金的信息披露.....	111
第十六部分	风险揭示.....	117
第十七部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	119
第十八部分	基金合同内容摘要.....	122
第十九部分	基金托管协议摘要.....	139
第二十部分	对基金份额持有人的服务.....	158
第二十一部分	其他应披露事项.....	160
第二十二部分	招募说明书存放及查阅方式.....	170
第二十三部分	备查文件.....	171

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律、法规及《诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书的内容涵盖诺安中证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的投资目标、投资理念、投资策略、风险以及申购和赎回的程序及费率等与投资基金有关的所有相关事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书，并注意基金管理人对本招募说明书披露的更新信息。

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。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合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，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《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在《诺安中证100指数证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金	指依据基金合同拟募集的诺安中证 100 指数证券投资基金
招募说明书	指《诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书》，即用于公开披露基金管理人及托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新
基金合同	指《诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同》及对该合同的任何修订和补充
中国	指中华人民共和国(仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

元	指中国法定货币人民币元
基金产品资料概要	指《诺安中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
托管协议	指基金管理人与基金托管人签订的《诺安中证 100 指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	指《诺安中证 100 指数证券投资基金基金份额发售公告》
《业务规则》	指《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
基金管理人	指诺安基金管理有限公司
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	指根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
基金代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指诺安基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构

基金合同当事人	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）



认购	指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
巨额赎回	指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（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）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	指投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约

	定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指基金投资所得的股票红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
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的过程
销售服务费	指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用
指定媒介	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
流动性规定	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
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
摆动定价机制	指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式

式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

公司名称：诺安基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层

法定代表人：秦维舟

成立日期：2003 年 12 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

电话：0755—83026688

传真：0755—83026677

股权结构：

股东单位	出资额(万元)	出资比例
中国对外经济贸易信托有限公司	6000	40%
深圳市捷隆投资有限公司	6000	40%
大恒新纪元科技股份有限公司	3000	20%
合计	15000	100%

### 二、证券投资基金管理情况

截至 2020 年 11 月 2 日，本基金管理人共管理六十二只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型

发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

### 三、主要人员情况

#### 1. 董事会成员

秦维舟先生，董事长，工商管理硕士。历任北京中联新技术有限公司总经理，香港昌维发展有限公司总经理，香港先锋投资有限公司总经理，中国新纪元有限公司副总裁，诺安基金管理有限公司副董事长。

张一冰女士，副董事长，硕士。历任中国华大理工技术公司计财部职员，中国对外经济贸易信托有限公司证券部总经理助理、综合业务部副科长、投资银行部总经理、稽核法律部总经理、投资发展部总经理、董事会秘书、公司副总经理

等职务。

赵忆波先生，董事，硕士。历任南方航空公司规划发展部项目经理，泰信基金管理有限公司研究员，翰伦投资咨询公司（马丁可利基金）投资经理，纽银西部基金管理有限公司基金经理，现任大恒科技副董事长。

刘洪波先生，董事，硕士。历任中国对外经济贸易信托有限公司投资银行部职员、资产管理四部职员、金融产品一部总经理助理、副总经理和总经理，信业股权投资管理有限公司资本市场部董事总经理，华澳国际信托有限公司北京业务总部/北京业务一部业务总监/部门总经理，现任中国对外经济贸易信托有限公司投资管理事业部副总经理。

孙晓刚先生，董事，本科。历任河北瀛源建筑工程有限公司职员、北京诺安企业管理有限公司副总经理、上海摩士达投资有限公司副总经理及投资总监、上海钟表有限公司副总经理。现任上海钟表有限公司董事长。

齐斌先生，董事，硕士。历任中国人民银行总行管理干部学院团委书记、中国证券交易系统有限公司职员、对外贸易经济合作部计划财务司股份制处主任科员、中国驻新加坡使馆商务参赞处一等秘书、中国中化集团公司投资部副总经理、中国中化集团公司战略规划部副总经理、中国对外经济贸易信托有限公司副总经理等，现任诺安基金管理有限公司总经理。

汤小青先生，独立董事，博士。历任国家计委财政金融司处长，中国农业银行市场开发部副主任，中国人民银行河南省分行副行长，中国人民银行合作司副司长，中国银监会合作金融监管部副主任，内蒙古银监局、山西银监局局长，中国银监会监管一部主任，招商银行副行长。

史其禄先生，独立董事，博士。历任中国工商银行外汇业务管理处处长，中国工商银行伦敦代表处首席代表，中国工商银行新加坡分行总经理，中国工商银行个人金融业务部副总经理，机构业务部副总经理，机构金融业务部资深专家。

钱学宁先生，独立董事，博士。历任福建省华侨信托投资公司上海证券部总经理、福建联华国际信托投资公司上海部首席代表、上海富成证券公司助理总裁、英国渣打银行私人银行北京分行筹备组成员、《银行家》杂志社副社长、中国社科院金融所助理研究员、全国人大常委会办公厅联络局分析组主笔、中国社科院陆家嘴研究基地副秘书长、中国社科院经济研究所助理研究员、中国社科院上市

公司研究中心副主任。

## 2. 监事会成员

秦江卫先生，监事，硕士。历任太原双喜轮胎工业股份有限公司全面质量管理处干部。2004 年加入中国对外经济贸易信托有限公司，历任中国对外经济贸易信托有限公司风险法规部总经理、副总法律顾问。现任中国对外经济贸易信托有限公司总法律顾问、首席风控官，兼任风控合规总部总经理。

赵星明先生，监事，金融学硕士。历任中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处副处长，深圳证券交易所理事会秘书长，君安证券香港公司副总经理等职。

戴宏明先生，监事，本科。历任浙江证券深圳营业部交易主管、国泰君安证券公司部门主管、诺安基金管理有限公司交易中心总监，现任诺安基金管理有限公司首席交易师（总助级）兼交易中心总监。

梅律吾先生，监事，硕士。历任长城证券有限责任公司研究员，鹏华基金管理有限公司研究员，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。

## 3. 经理层成员

齐斌先生，总经理，硕士研究生学历。历任中国人民银行总行管理干部学院团委书记、中国证券交易系统有限公司职员、对外贸易经济合作部计划财务司股份制处主任科员、中国驻新加坡使馆商务参赞处一等秘书、中国中化集团公司投资部副总经理、中国中化集团公司战略规划部副总经理、中国对外经济贸易信托有限公司副总经理等。2019 年加入诺安基金管理有限公司，现任公司总经理。

杨谷先生，副总经理，经济学硕士，CFA。曾任平安证券公司综合研究所研究员，西北证券公司资产管理部研究员。2003 年加入诺安基金管理有限公司，历任权益投资事业部总经理，现任公司副总经理、诺安先锋混合型证券投资基金基金经理。

田冲先生，副总经理兼首席信息官，硕士。曾任深圳市邮电局红荔储汇证券营业部工程师、光大证券信息技术部高级经理。2004 年加入诺安基金管理有限公司，历任信息技术部总监，运营保障部总监，网络金融部总监，公司总裁助理。现任公司副总经理兼首席信息官。

马宏先生，督察长，硕士。曾任中国新兴（集团）总公司职员、中化财务公

司证券部职员、中化国际贸易股份有限公司投资部副总经理、中国对外经济贸易信托有限公司证券部投资总监、资产管理二部副总经理、投资发展部总经理。2016 年加入诺安基金管理有限公司，现任公司督察长。

#### 4. 基金经理

梅律吾先生，硕士，具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司。2005 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监，现任指数组负责人。曾于 2007 年 11 月至 2009 年 10 月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理，2009 年 3 月至 2010 年 10 月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理，2011 年 1 月至 2012 年 7 月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理，2011 年 9 月至 2012 年 11 月担任诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 8 月至 2017 年 10 月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015 年 6 月至 2019 年 1 月任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 8 月任诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2012 年 7 月至 2019 年 5 月任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，2017 年 8 月至 2019 年 6 月任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2014 年 2 月至 2019 年 7 月任诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012 年 7 月起任诺安中证 100 指数证券投资基金基金经理，2018 年 8 月起任诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理，2019 年 1 月起任诺安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2019 年 5 月起任诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 5. 历任基金经理

王坚先生，2009 年 10 月至 2012 年 11 月担任本基金基金经理。

#### 6. 投资决策委员会成员的姓名及职务

本公司投资决策委员会分股票类基金投资决策委员会、固定收益类基金投资决策委员会、指数类基金投资决策委员会及 QDII 类基金投资决策委员会，具体如下：

股票类基金投资决策委员会：主席由公司总经理齐斌先生担任，委员包括：



杨谷先生，公司副总经理、基金经理；韩冬燕女士，总经理助理、权益投资事业部总经理、基金经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

固定收益类基金投资决策委员会：主席由公司总经理齐斌先生担任，委员包括：杨谷先生，公司副总经理、基金经理；谢志华先生，总经理助理、固定收益事业部总经理、基金经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

指数类基金投资决策委员会：主席由公司总经理齐斌先生担任，委员包括：杨谷先生，公司副总经理、基金经理；梅律吾先生，指数投资组负责人、基金经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

QDII 类基金投资决策委员会：主席由公司总经理齐斌先生担任，委员包括：韩冬燕女士，总经理助理、权益投资事业部总经理、基金经理；宋青先生，国际业务部总监、基金经理；王创练先生，首席策略师（总助级）兼研究部总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 四、基金管理人的职责

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

- （1）依法募集基金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；

（10）依据基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

（13）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；

（14）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；

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

（16）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；

（17）法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制中期和年度基金报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益

时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

（22）如基金管理人依法将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

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

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 五、基金管理人的承诺

### 1. 基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

### 2. 基金管理人承诺不从事以下禁止性行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为及基金合同禁止的行为。

### 3. 基金经理承诺

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

（2）不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、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不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。

## 六、基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

### 1. 风险管理及内部控制制度概述

公司风险管理及内部控制是公司有效防范和控制经营风险和基金资产运作风险，保证公司规范经营、稳健运作，确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整，及时维护公司的良好声誉及股东合法权益，在充分考虑内外部环境因素的基础上，通过构建科学的组织机制、运用有效的管理方法、实施严格的操作程序与控制措施而形成的控制风险的管理系统。

公司风险管理及内部控制的总体目标在于建立一个决策科学、运营规范、管理高效、持续健康发展的资产管理实体，在充分保障基金份额持有人利益的基础上，维护公司的良好声誉及公司股东的合法权益。

### 2. 风险管理制度

#### （1）风险管理的具体目标

根据国家相关法律法规及公司内部控制大纲的具体要求，公司风险管理的总体目标为：

- 1) 确保国家法律法规、行业规章和公司各项管理规章制度的贯彻执行；
- 2) 建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；
- 3) 不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额持有人经风险调整后的利益最大化；
- 4) 通过严格的风险控制体系和管理措施，保障公司发展战略的顺利实施和经营目标的全面实现，维护公司及公司股东的合法权益；
- 5) 建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度，及

时查错防弊、堵塞漏洞,保证各项业务稳健运行;

- 6) 借鉴和引用国际上成熟、先进的风险控制理念和技术,不断提升公司国际化经营水准和核心竞争能力,巩固公司的声誉和市场份额。

## (2) 风险管理的原则

公司的风险管理严格遵循以下原则:

- 1) 首要性原则:公司经营管理层将始终把风险管理置于公司经营中的战略层面并作为首要任务;

- 2) 全面性原则:风险管理制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

- 3) 审慎性原则: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;

- 4) 独立性原则:合规审查与风险控制委员会、风险控制办公会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性;

- 5) 有效性原则:风险管理制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,并成为所有员工严格遵守的行动指南;

- 6) 适时性原则:风险控制制度的制订应当具有前瞻性。同时,随时对各项制度进行适时的更新、补充和调整,使其适应基金业的发展趋势和最新法律法规的要求;

- 7) 防火墙原则:公司各业务部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

## (3) 风险管理的具体内容

- 1) 确立加强风险控制的指导思想,以及风险控制的目标和原则;

- 2) 建立层次分明、权责明确、涵盖全面的风险控制体系;

- 3) 建立定性和定量相结合的风险控制方法;

- 4) 建立严格合理的风险控制程序和措施;

- 5) 制定持续有效的风险控制制度的评价和检查机制。

## (4) 风险管理的体系

- 1) 依据风险管理的具体目标与原则,公司设立了以下风险管理机构及

职能部门：

- a. 董事会下设合规审查与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资管理中的合法、合规性进行全面、重点的检查分析评价，对公司经营和基金投资管理中的风险进行合规检查和风险控制评估。并出具相应的工作报告和专业意见提交董事会。
- b. 公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和督察长的职责进行工作。
- c. 公司设风险控制办公会，在总经理的领导下制定公司风险管理制度和政策，对公司风险控制部提交的风险评估报告作出全面的讨论和决定，从而使风险政策得到有力的执行。
- d. 公司设监察稽核部，监察稽核部在各部门自我监察的基础上依照所规定的职责权限、工作程序进行独立的再监督工作，对公司经营的法律法规风险进行管理和监察，与公司各部门保持相对独立的关系；定期向管理层提交监察稽核报告。
- e. 公司设风险控制部，负责根据公司各类业务的特点和需求，制定各个风险领域（投资、运作、信用等）的风险管理和绩效评估方法，并监督其执行；定期向管理层提交风险评估报告。

2) 为最大限度地实现风险管理的目标，公司以各机构及职能部门为依托，自上而下，建立了包括公司治理结构层、公司经营管理层、职能机构层、具体操作层在内的四级合规风险管理组织体系：

第一层治理结构层：由董事会合规审查与风险控制委员会进行宏观领导，负责对公司经营管理和基金投资管理中的合法、合规性进行全面、重点的检查分析评价，对公司经营和基金投资管理中的风险进行合规检查和风险控制评估。

第二层经营管理层：由管理层下设的公司合规风控委员会进行中观管理，公司合规风控委员会每月召开例会，公司经营管理层制定合规风险管理制度和政策，对风险控制部提交的《风险评估报告》、监察稽核部提交的《合规月报》作出相应反馈和指示，从而使公司的风险控制措施得到有力的执行。

第三层职能机构层：公司在专职合规风险控制运作模式上采用双线独立运作模式，监察稽核部和风险控制部作为职能部门，对公司核心风险要素进行具体的识别与管理。公司设立了风险控制部，对产品投资风险进行监控，制定并提交各种形式的风险分析评估报告。公司设立了监察稽核部，在各部门自我监察的基础上依照所规定的职责权限、工作程序进行独立的再监督工作，对公司经营与产品运作的法律法规风险、员工行为、子公司合法合规性进行监督和检查。

第四层具体操作层：各业务相关部门对各自部门的风险控制负责，各业务部门各设一名合规管理人员，落实本部门风险管理工作。

### 3) 数量化的投资风险控制体系

公司针对投资过程中的事前风险、事中风险和事后风险建立了一整套的数量化风险控制体系，从而做到在每个环节有效控制风险点。

投资前的风险控制主要是通过严谨、细致的研究工作，定性与定量相结合的方法来实现。研究员通过实地调研对上市公司作出定性的判断，同时公司还通过量化的指标体系，如：风险指标体系（包括标准差、跟踪误差、下方风险、组合 VaR 等）、流动性指标体系等，挑选价值相对被低估的股票，运用数量化模型进行价值评估。

事中的风险控制通过两个手段来实现，一是在交易系统中设置风险控制条目，当基金经理下达与公司风险管理规定不符的指令时，指令将不能被执行，从技术上防止了不当投资行为的发生。第二是高频率的投资情况报告，可随时掌握投资过程中的股票仓位、集中度、流动性多方面的状况。

事后风险控制包括业绩评价和业绩归因，主要是把业绩逐层分解为资产策略配置效应、行业选择效应和个股选择效应，同时为优化投资策略提供参考。

## 3. 内部控制制度

### （1）内部控制的目标

为在守法经营、规范运作的基础上,实现持续、稳定、健康发展的经营目标,公司内部控制的总体目标为:



- 1) 使公司诚实信用、勤勉尽责地为投资者服务，保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- 2) 保护公司资产的安全，实现公司经营方针和目标，维护股东权益；
- 3) 树立良好的品牌形象，维护公司最重要的资本-声誉；
- 4) 健全公司法人治理结构，建立符合现代管理要求的内部组织结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；
- 5) 建立切实有效的内部控制系统，查错防弊，消除隐患，保证业务稳健运行；
- 6) 规范公司与股东之间的关联交易，避免股东干涉公司正常的经营管理活动。

## （2）内部控制的原则

公司内部控制制度的建立严格遵循以下原则

- 1) 全面性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；
- 2) 有效性原则：一方面，通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；另一方面，强化内部管理制度的高度权威性，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；
- 3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上保持相对独立性；内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立、执行部门，公司基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离；
- 4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的相互制约措施来消除内部控制中的盲点；
- 5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## （3）内部控制制度的主要内容

内部控制主要包括环境控制和业务控制。

- 1) 环境控制：指与内部控制相关的环境因素相互作用的综合效果及其对业务、员工的影响力，环境控制构成公司内部控制的基础。公司致力于从治理结构、组织机构、企业文化、员工素质控制等方面实现良好的环境控制。
- 2) 业务控制：包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、

会计系统控制、监察稽核控制及其它方面的内部控制等。

- a. 投资管理业务控制：涉及到研究业务控制、投资决策业务控制、基金交易业务控制和对关联方交易的监控：

I) 研究业务控制主要包括：

公司的研究工作应保持独立、客观，为公司基金投资运作以及公司业务的全局发展提供全方位的支持；建立科学的研究工作管理流程和投资对象备选库制度；建立研究与投资的业务交流制度；建立研究报告质量评价体系。

II) 投资决策业务控制主要包括：

严格遵守法律法规的有关规定及基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求；健全投资决策授权制度，实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制；投资决策应当有充分的投资依据，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持，并保留决策记录；建立投资风险评估与管理制度；建立科学的投资管理业绩评价体系；督察长和监察稽核部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查；相关业务人员应遵循良好的职业道德规范，严禁损害基金份额持有人利益事件的发生。

III) 基金交易业务控制主要包括：

实行集中交易制度；投资决策和交易执行实行严格的人员和空间分离制度，建立交易执行的权限控制体系和交易操作规则；建立完善的交易监测、预警和反馈系统；执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待；建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等文件；制定相应的特殊交易的流程和规则；建立科学的交易绩效评价体系；建立关联方交易的监控制度。

- b. 信息披露控制：公司按照法律、法规和中国证监会的有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。按照程序进行信息的组织、审核和发布。公司制定了严格的保密制度。公司掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

- c. 信息技术系统控制：公司根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用

性、可操作性原则，制定了信息系统的管理制度。公司信息技术系统硬件及软件的设计、开发均符合国家、金融行业软件工程标准的要求并实现了全面的业务电子化；公司实行严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度、信息数据的保存和备份制度、信息技术系统的稽核检查制度等管理措施，确保系统安全运行。

- d. 会计系统控制：公司根据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制定了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。主要包括以下方面：

明确职责划分与岗位分工；对所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立；基金会计核算独立于公司会计核算；采取适当的会计控制措施；建立凭证制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任；建立账务组织和账务处理体系，有效控制会计记账程序；建立复核制度；采取合理的计价方法和科学的计价程序，公允反映基金所投资的有价证券在计价时点的价值；规范基金清算交割工作，确保基金资产的安全；建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督；制定完善的会计档案保管和财物交接制度，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密；自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

- e. 监察稽核控制：公司设立督察长，督察长直接对董事会负责，经董事会聘任，并报中国证监会核准。公司设立监察稽核部，对公司经营层负责，开展监察稽核工作，并保证监察稽核部门的独立性和权威性，确保公司各项经营管理活动的有效运行。
- f. 其他内部控制机制：其他内部控制包括对销售和客户服务控制、对基金托管人和基金代销机构等合作方的控制、授权控制、危机处理控制、持续的控制检验等。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### 二、主要人员情况

截至 2020 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2020 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1094 只。自 2003 年以来，本行连续十七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 73 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

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

##### 2、内部风险控制组织结构

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

##### 3、内部风险控制原则

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

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范

程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

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

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

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

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

#### 4、内部风险控制措施实施

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

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

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

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源

利用和效益最大化目的。

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

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

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

#### 5、资产托管部内部控制情况

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

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

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

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作

为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

## 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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



## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）诺安基金管理有限公司直销中心

本公司在深圳、上海、广州、成都开设四个直销网点对投资者办理开户和本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的申购、赎回等业务：

##### （1）深圳直销中心

办公地址：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层

邮政编码：518048

电话：0755-83026603 或 0755-83026620

传真：0755-83026630

联系人：祁冬灵

##### （2）上海分公司

办公地址：上海浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪中心大厦 903 室

邮政编码：200120

电话：021-68824617

传真：021-68362099

联系人：王惠如

##### （3）广州分公司

办公地址：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 2908

邮政编码：510623

电话：020-38928980

传真：020-38928980

联系人：黄怡珊

##### （4）西部营销中心

办公地址：成都市高新区府城大道西段 399 号天府新谷 9 栋 1 单元 1802

邮政编码：610021

电话：028-86050157

联系人：裴兰

##### （5）个人投资者可以通过基金管理人的网上直销交易系统办理开户和本

基金 A 类基金份额、C 类基金份额的申购和赎回手续，具体交易细节请参阅基金管理人网站公告。

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

## （二）基金代销机构

### 1、A 类基金份额

#### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客户服务热线：95588

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

#### （2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

#### （3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人：田国立

客户服务热线：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

#### （4）交通银行股份有限公司

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）长宁区仙霞路 18 号

法定代表人：任德奇

客户服务热线：95559

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

#### （5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务热线：95555

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

（6）平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

客户服务热线：95511-3

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

（7）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙 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

客户服务电话：95526

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

（8）宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：钱庚旺

客户服务热线：95574

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

（9）上海浦东发展银行股份有限公司

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：吉晓辉

客户服务电话：95528

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

（10）温州银行股份有限公司

住所及办公地址：温州市车站大道华海广场 196 号

法定代表人：邢增福

客户服务热线：96699（浙江）、962699（上海）、0577-96699（其他地区）

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

(11) 杭州银行股份有限公司

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

法定代表人：陈震山

客户服务电话：95398、400-8888-508

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

(12) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

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

(13) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

客户服务热线：95568

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

(14) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

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

(15) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

办公地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

客户服务电话：95319

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

(16) 广发银行股份有限公司

注册地址：中国广东省广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客户服务热线：400-830-8003

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

(17) 南京银行股份有限公司

注册地址：南京市玄武区中山路 288 号

办公地址：南京市中山路 288 号

法定代表人：胡升荣

客户服务电话：95302

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

(18) 洛阳银行股份有限公司

注册地址：河南省洛阳市洛阳新区开元大道与通济街交叉口

办公地址：河南省洛阳市洛龙区开元大道 256 号

法定代表人：王建甫

客户服务电话：0379-96699

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

(19) 齐商银行股份有限公司

注册地址：山东省淄博市张店区中心路 105 号

办公地址：山东省淄博市张店区中心路 105 号

法定代表人：臧传勇

客户服务电话：400-8696-588

网址：[www.qsbank.cc](http://www.qsbank.cc)

(20) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融·碧玉蓝天大厦 16 至 23 楼

法定代表人：翼光恒

客户服务电话：021-962999、4006962999

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

(21) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

客户服务电话：400-888-8811、95541

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

(22) 烟台银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

客户服务电话：4008-311-777

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

(23) 哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

客户服务电话：40060-96358、95537

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

(24) 兴业银行股份有限公司

注册地址：中国福州市湖东路 154 号

办公地址：中国福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

客户服务电话：95561

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

(25) 北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼

办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼

法定代表人：王金山

客户服务电话：400-66-96198（全国）、96198（北京）

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

(26) 威海市商业银行股份有限公司

注册地址：中国·威海市宝泉路 9 号

办公地址：威海市宝泉路 9 号财政大厦

法定代表人：谭先国

客户服务电话：96636（省内）、4000096636(境内)

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

(27) 郑州银行股份有限公司

注册地址：中国郑州郑东新区商务外环路 22 号郑银大厦

办公地址：中国郑州郑东新区商务外环路 22 号郑银大厦

法定代表人：王天宇

客户服务电话：967585（河南地区）、4000-967585（全国）

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

(28) 包商银行股份有限公司

注册地址：包头市青山区钢铁大街 6 号

办公地址：包头市青山区钢铁大街 6 号

法定代表人：周学东

客户服务电话：95352

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

(29) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常熟市新世纪大道 58 号

办公地址：江苏省常熟市新世纪大道 58 号

法定代表人：宋建明

客户服务电话：0512-962000、4009962000

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

(30) 江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：(0519)96005

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

(31) 广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

法定代表人：王继康

客户服务电话：95313

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

(32) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客户服务电话：96067

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

(33) 江苏紫金农村商业银行股份有限公司

注册地址：南京市建邺区梦都大街 136 号

办公地址：南京市建邺区梦都大街 136 号

法定代表人：张小军

客服电话：96008

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

(34) 昆仑银行股份有限公司

注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号

办公地址：新疆克拉玛依市世纪大道 7 号

法定代表人：蒋尚军

客服电话：95379



公司网址：[www.klb.cn](http://www.klb.cn)

(35) 中原银行股份有限公司

注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

法定代表人：窦荣兴

客户服务电话：95186

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

(36) 福建海峡银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市六一北路 158 号

办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 358 号

法定代表人：苏素华

客户服务电话：400-893-9999

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

(37) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：贺青

客户服务热线：95521、4008888666

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

(38) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

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

(39) 申万宏源西部证券有限公司

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

办公地址：北京西城区太桥大街 19 号

法定代表人：李琦

客户服务电话：400-800-0562

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

(40) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：400-8888-888 或 95551

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

(41) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587、4008888108

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

(42) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 42 楼

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、10、18、19、35、  
36、38、39-44 楼

法定代表人：孙树明

客户服务热线：95575 或（020）95575

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

(43) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务热线：95548

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

(44) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

客户服务热线：95525

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

(45) 海通证券股份有限公司

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

客户服务热线：95553、4008888001、021-95553

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

(46) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼

法定代表人：武晓春

客户服务热线：400-8888-128

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

(47) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

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

(48) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

客户服务热线：95386、400-828-5888

网址：<https://www.njzq.com.cn>

(49) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省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

客户服务热线：95597

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

(50) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531、400-8888-588

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

(51) 湘财证券股份有限公司

注册地址：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：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：林俊波

客户服务热线：95351

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

(52) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

客户服务电话：95562

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

(53) 国都证券股份有限公司

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

客户服务热线：400-818-8118

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

(54) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市河西区宾水道 8 号

法定代表人：王春峰

客户服务热线：400-651-5988

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

(55) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层—29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层—29 层、32、  
36、39、40 层

法定代表人：潘鑫军

客户服务热线：95503

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

(56) 国元证券股份有限公司

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

法定代表人：蔡咏

客户服务热线：95578、4008888777

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

(57) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：李俊杰

客服服务热线：4008918918、021-962518

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)、[www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(58) 东北证券股份有限公司

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

客户服务热线：95360

网址：www.nesc.cn

(59) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(60) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层

法定代表人：侯巍

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn

(61) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：姚志勇

客户服务电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(62) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区

法定代表人：吴承根

客户服务电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

(63) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：赵洪波

客户服务电话：400-666-2288

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

(64) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：钱华

客户服务电话：4001-962-502

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

(65) 华宝证券有限责任公司

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

客户服务电话：400-820-9898

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

(66) 方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：高利

客户服务电话：95571

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

(67) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客户服务电话：95336、40086-96336

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

(68) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客户服务电话：95321

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

(69) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

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

全国统一客户服务电话：95536

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

(70) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人：刘世安

客户服务电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

(71) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：黄炎勋

客户服务电话：95517、4008-001-001

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

(72) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 楼

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 楼

法定代表人：霍达



客户服务电话：95565

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

(73) 中国中金财富证券有限公司（原中国中投证券有限责任公司）

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 4 层、  
18 至 21 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层  
至 21 层

法定代表人：高涛

客户服务电话：95532、4006008008

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

(74) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：广东省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

客户服务电话：95328

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

(75) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 16/17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道特区报业大厦 16/17 层

法定代表人：曹宏

客户服务电话：400-6666-888 、95514

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

(76) 国融证券股份有限公司

注册地址：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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 4 号楼 11 层国融  
证券

法定代表人：张智河

客户服务电话：400-660-9839、95385

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

(77) 中航证券有限公司

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

客户服务热线：95335、400-88-95335

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

(78) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7-8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7-9 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：96326（福建）、400-88-96326（全国）

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

(79) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

客户服务电话：95390、400-898-9999

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

(80) 大通证券股份有限公司

注册地址：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：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 39 层

法定代表人：赵玺

客户服务电话：4008-169-169

网址：[www.daton.com.cn](http://www.daton.com.cn)、[www.estock.com.cn](http://www.estock.com.cn)

(81) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客户服务电话：95377

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

(82) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

客户服务电话：95563、0771-95563

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

(83) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

客户服务电话：4008096096、95355

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

(84) 东兴证券股份有限公司

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

客户服务电话：95309

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

(85) 财达证券股份有限公司

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 24 层

法定代表人：翟建强

客户服务电话：95363（河北省内）、0311-95363（河北省外）

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

(86) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 26 号同德广场写字楼 31 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 26 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

客户服务电话：400-6650-999

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

(87) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

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

(88) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 2001

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

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

网址：<http://sd.citics.com>

(89) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省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

客户服务电话：95358

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

(90) 华西证券股份有限公司

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

客户服务电话：400-8888-818、95584

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(91) 红塔证券股份有限公司

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 号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人：李素明

客户服务电话：400-871-8880

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

(92) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

客户服务电话：95582

网址：[www.west95582.com](http://www.west95582.com)

(93) 华鑫证券有限责任公司

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

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦第 28 层 A01、B01(b) 单元

法定代表人：俞洋

客户服务电话：95323（全国）、4001099918（全国）、029-68918888（西安）

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

(94) 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客户服务热线：95318

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

(95) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007-121-212

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

(96) 首创证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

客户服务电话：95381

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

(97) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：陈灿辉

客户服务电话：4008205999

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

(98) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法人代表：叶顺德

客户服务热线：95399

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

(99) 联储证券有限责任公司

注册地址：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；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；北京市朝阳区

区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层

法定代表人：吕春卫

客户服务电话：400-620-6868

网址：www.lczq.com

（100）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 41-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 41-42 层

法定代表人：李强

客服电话：400-832-3000

网站：www.csc.com.cn

（101）中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

客户服务电话：024-95346

网址：www.iztzq.com

（102）万联证券股份有限公司

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 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：张建军

客户服务电话：95322

网址：www.wlzq.cn

（103）中信证券华南股份有限公司

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

客户服务电话：95396

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

(104) 中宏人寿保险有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 6 楼

法定代表人：何达德

客户服务电话：95383

网址：[www.manulife-sinochem.com](http://www.manulife-sinochem.com)

(105) 中信期货有限公司

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、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

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

(106) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

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

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

(107) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

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：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法人代表人：洪弘

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://money.jrj.com.cn>

(108) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟



客户服务电话：400-820-2899

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

(109) 上海天天基金销售有限公司

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

客户服务电话：400-1818-188、95021

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

(110) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

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

客户服务电话：400-001-8811

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

(111) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

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

(112) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

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

(113) 上海好买基金销售有限公司

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：上海浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

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

(114) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)、[www.licaike.com](http://www.licaike.com)

(115) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：吴强

客户服务电话：952555

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

(116) 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区华富街道深南中路 4026 号田面城市大厦 18 层 b

办公地址：深圳市福田区深南中路 4026 号田面城市大厦 18 楼 ABC

法定代表人：杨启香

客户服务电话：4009-908-600

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

(117) 北京展恒基金销售股份有限公司

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 邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-8000

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

(118) 一路财富(北京)基金销售有限公司

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：北京西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层 2208

法定代表人：吴雪秀

客户服务电话：400-001-1566

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

(119) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街中关村金融大厦 10 层

法定代表人：赵荣春

客户服务电话：400-893-6885

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

(120) 北京晟视天下基金销售有限公司

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 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：010-58170761

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

(121) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

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 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

客户服务电话：400-6099-200

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

(122) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号新华 1949 产业园东门

法定代表人：曲阳

客户服务电话：400-600-0030

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

(123) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

客户服务电话：400-821-3999

网址：<https://tty.chinapnr.com>

(124) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客户服务电话：95733

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

(125) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：（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：（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

客户服务电话：4008219031

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

(126) 诺亚正行基金销售有限公司

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

客服电话：400-821-5399

网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(127) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层  
4609-10 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层  
4609-10 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

(128) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院泰康金融大厦 38 层

法定代表人：张冠宇

客户服务电话：400-819-9869

网址：www.tdyhfund.com

(129) 上海凯石财富基金销售有限公司

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

客户服务电话：400-643-3389

网址：www.vstonewealth.com

(130) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

客户服务电话：400-918-0808

公司网址：www.xds.com.cn、www.dkhs.com

(131) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：4006199059

公司网址：www.hcjijin.com

(132) 珠海盈米基金销售有限公司

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 1 号保利国际广场南塔 12 楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(133) 上海联泰基金销售有限公司

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 层

法人代表：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

公司网址：www.66liantai.com

(134) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

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

法人代表：钱昊旻

客户服务电话：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

(135) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海德三路航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法人代表：TEO WEE HOWE

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(136) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法人代表：王兴吉

客户服务电话：400-088-8080

公司网址：www.qiandaojr.com

(137) 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：乐贤龙

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(138) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客户服务电话：400-623-6060

公司网址：www.niuniufund.com

(139) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(140) 泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间

办公地址：北京市海淀区西四环北路 69 号一层

法定代表人：张虎

客户服务电话：400-1687575

公司网址：www.taixincf.com

(141) 凤凰金信（海口）基金销售有限公司（原凤凰金信（银川）基金销售有限公司）

注册地址：海南省海口市滨海大道 32 号复兴城互联网创新创业园 E 区 4 层

办公地址：海南省海口市滨海大道 32 号复兴城互联网创新创业园 E 区 4

层

法定代表人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

（142）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：黄祎

客户服务电话：400-821-0203

（143）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

客户服务电话：400-111-0889

公司网站：www.gomefund.com

（144）北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：曲馨月

客户服务电话：400-100-3391

公司网站：www.bjdycfund.com

（145）和谐保险销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302

办公地址：北京市朝阳区建外大街 6 号安邦保险大厦 10 层

法定代表人：左荣林

客户服务电话：95569

网址：www.hx-sales.com

（146）北京懒猫基金销售有限公司（原北京懒猫金融信息服务有限公司）

注册地址：北京市石景山区金府路 32 号院 3 号楼 9 层 940 室



办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 3 号安联大厦 901 室

法定代表人：赵劲松

客户服务电话：010-85965200

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

(147) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

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

(148) 京东肯特瑞基金销售有限公司（原北京肯特瑞基金销售有限公司）

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院

法定代表人：王苏宁

客户服务电话：95118 或 400-098-8511（个人业务）

400-088-8816（企业业务）

网址：<http://fund.jd.com>

(149) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼

法定代表人：沈丹义

客户服务电话：400-101-9301 或 95193 转 5

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

(150) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

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

（151）万家财富基金销售（天津）有限公司

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 5 层

法定代表人：李修辞

客户服务电话：010-59013895

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

（152）北京蛋卷基金销售有限公司

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望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：400-159-9288

网址：<http://danjuanapp.com>

（153）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市高淳区砖墙镇 78 号

办公地址：上海市黄浦区龙华东路 868 号绿地海外滩办公 A 座 1605

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

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

（154）大河财富基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

客户服务电话：0851-88235678

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

（155）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市北京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

法定代表人：周斌

客户服务电话：400-8980-618

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

（156）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：沈茹意

客户服务电话：021-68889082

网址：[www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

（157）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

法定代表人：吕柳霞

客户服务电话：400-711-8718

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

（158）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-673-7010

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

（159）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客户服务电话：4006-802-123

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(160) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：王锋

客户服务电话：95177

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

(161) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

客服电话：95510

网址：<http://fund.sinosig.com>

(162) 方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号楼神华国华投资大厦 7 层 711

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号楼神华国华投资大厦 7 层 711

法定代表人：林柏均

客服电话：010-64068617

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

(163) 北京度小满基金销售有限公司（原北京百度百盈基金销售有限公司）

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：葛新

客户服务电话：95055-4

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

(164) 江苏天鼎证券投资咨询有限公司

注册地址：南京市秦淮区太平南路 389 号 1002 室

办公地址：南京市鼓楼区平安里 74 号

法定代表人：金婷婷

客户服务电话：025-962155

网址：[www.tdtz888.com](http://www.tdtz888.com)

（165） 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 层 806

法定代表人：路昊

客户服务电话：4001115818

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

（166） 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-818

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

（167） 深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1(811-812)

办公地址：辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路 52 号民生金融中心 22 楼盈信基金

法定代表人：苗宏升

客户服务电话：4007-903-688

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

（168） 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：王旋

客户服务电话：400-0555-671

网址：www.hgccpb.com

（169）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层

法定代表人：樊怀东

客户服务电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

（170）海银基金销售有限公司

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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

法定代表人：巩巧丽

客户服务电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时在基金管理人网站公示。

## 二、注册登记机构

名称：诺安基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19—20 层

法定代表人：秦维舟

电话：0755-83026688

传真：0755-83026677

## 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：北京颐合中鸿律师事务所

住所：北京市东城区建国门内大街 7 号光华长安大厦 2 座 1910 室

法定代表人/负责人：付朝晖

电话：010-65178866

传真：010-65180276

经办律师：虞荣方

## 四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场 E2 座 8 层

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

联系人：左艳霞

经办注册会计师：左艳霞、张品

## 第六部分 基金份额的分类

自 2020 年 10 月 28 日起，本基金分设 A 类基金份额和 C 类基金份额。

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

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类基金份额净值 = 计算日该类基金份额的基金资产净值 / 计算日该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整基金份额分类规则、调整现有基金份额类别的费率水平或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。



## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、 申购与赎回场所

本基金的申购和赎回将通过基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点进行。投资者也可以通过本基金管理人的基金网上交易系统进行申购赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示

### 二、 申购与赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

本基金将上海证券交易所、深圳证券交易所的每一个交易日设为开放日，为投资者办理申购、赎回业务，办理时间为上午 9：30—下午 3：00。

#### 2、 申购、赎回的开始时间

本基金基金合同于 2009 年 10 月 27 日生效，于 2010 年 1 月 12 日开始办理日常申购、赎回业务。

3、若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购/赎回的时间进行调整，但此项调整根据《信息披露办法》的规定在指定媒介公告

4、投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日的相应价格。

### 三、 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定的媒介公告。

## 四、 申购与赎回的程序

### 1、 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金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，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

### 2、 申购和赎回申请的确认

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

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3、 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

## 五、 申购与赎回的限制

1、通过本公司直销中心申购本基金，每个基金账户首次申购的最低金额为1,000元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币1,000元（含申购费）。通过本公司网上交易系统（目前仅对个人投资者开通）申购本基金，每个基金账户首次申购的最低金额为100元人民币（含申购费），追加申购的最低金额为人民币100元（含申购费）。

2、通过本公司直销中心赎回本基金，基金份额持有人赎回本基金的最低份额为100份基金份额。通过本公司网上直销平台赎回本基金，单笔赎回申请的最低份额不作限制。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回

导致该基金份额持有人在一个网点的基金份额余额少于相应的最低赎回限额时，余额部分的基金份额必须一同赎回。

3、各代销机构对上述最低申购限额、交易级差、最低赎回份额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的申购的金额和赎回的份额的数量限制，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介公告。

5、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。

## 六、 申购与赎回的费用

### （一）申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费。本基金 A 类基金份额申购费率随申购金额的增加而递减，具体费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%
500 万元 ≤ M < 1000 万元	0.2%
M ≥ 1000 万元	1000 元/每笔

### （二）赎回费用

（1）对于本基金 A 类基金份额，赎回费用由赎回人承担，其中 25% 的部分归基金资产所有，其余部分可用于注册登记等相关费用。本基金的赎回费率随持有期递减，最高不超过赎回总金额的 1.5%，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。具体费率如下：

持有年限（N）	赎回费率
N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N < 2 年	0.5%

2 年≤N<3 年	0.25%
N≥3 年	0

(2) 对于本基金 C 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的 C 类基金份额的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。具体费率如下：

持有期限 (N)	赎回费率
N<7 日	1.50%
N≥7 日	0

## 七、申购和赎回金额的数额和价格

### (一) 申购份额及余额、赎回金额的处理方式

1、申购份额及余额的处理方式：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，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### (二) 申购份额

#### (1) A 类基金份额

本基金 A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，  
 净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

基金份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例一：假定 T 日的基金份额净值为 1.450 元。四笔申购金额分别为 1,000.00 元、100 万元、500 万元和 1000 万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购 1	申购 2	申购 3	申购 4
--	------	------	------	------

申购金额（元，a）	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00	10,000,000.00
适用申购费率（b）	1.2%	0.8%	0.2%	-
净申购金额（ $c=a/(1+b)$ ）	988.14	992,063.49	4,990,019.96	9,999,000.00
申购费（ $d=a-c$ ）	11.86	7,936.51	9,980.04	1,000.00
基金份额净值（e）	1.450	1.450	1.450	1.450
申购份额（ $=c/e$ ）	681.47	684,181.72	3,441,393.08	6,895,862.07

## （2）C 类基金份额

若投资人选择 C 类基金份额，则申购份额的计算公式如下：

申购份额=申购金额/ 申购当日 C 类基金份额净值

例二：假定 T 日 C 类基金份额净值为 1.110 元。某投资人投资 100,000 元申购本基金，则可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.110=90,090.09 份

即：投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日的 C 类基金份额净值为 1.110 元，则其可得到 90,090.09 份 C 类基金份额

## （三）赎回金额

基金赎回金额的计算

赎回费 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 - 赎回费

例三：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，持有期限 1 年，该日 A 类基金份额净值为 1.350 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000.00×1.350=13,500.00 元

赎回费用=13,500.00×0.5%=67.50 元

净赎回金额=13,500.00-67.50=13,432.50 元

例四：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，持有期限 2 年，该日 A 类基金份额净值为 1.450 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000.00×1.450=14,500.00 元

赎回费用=14,500.00×0.25%=36.25 元

净赎回金额=14,500.00-36.25=14,463.75 元

例五：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，持有 3 年，该日 A 类基金份额净值为 1.625 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000.00 \times 1.625 = 16,250.00 \text{ 元}$$

例六：假定 T 日的 C 类基金份额净值为 1.132 元。某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有 3 天，对应的赎回费率为 1.5%，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.132 = 11,320.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.132 \times 1.5\% = 169.80 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,000 \times 1.132 - 169.80 = 11,150.20 \text{ 元}$$

#### （四）基金份额资产净值的计算公式

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。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。具体计算公式为：

$$T \text{ 日该类基金份额净值} = T \text{ 日该类基金资产净值} / T \text{ 日该类基金份额总份数}$$

### 七、 申购和赎回的注册登记

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

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前根据《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

### 八、 拒绝或暂停接受申购的情况及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

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

（3）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

（4）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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

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

（7）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。当发生上述第（6）项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 九、 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

（2）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；

（3）证券交易所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（4）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回

申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已确认接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受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。

同时，在出现上述第（4）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在指定的媒介公告。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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介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介上公告。

## 十、 巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，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。

### 2、巨额赎回的处理方式

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

（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）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；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。

(3) 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的 30%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 30%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 30%以内（含 30%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(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，并应当在指定媒介上进行公告。

巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒介及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，根据《信息披露办法》的规定在指定媒介公告，同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

## 十一、重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应根据《信息披露办法》的规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

## 十二、基金的转换

基金转换是指投资者在持有基金管理人发行的任一开放式基金后，可将其持有的基金份额直接转换成基金管理人管理的其它开放式基金的基金份额，而不需要先赎回已持有的基金份额，再申购目标基金的一种业务模式。

基金管理人已在直销机构及部分代销机构开通了本基金 A 类基金份额、C 类基金份额与基金管理人旗下诺安平衡证券投资基金（基金代码：320001）、诺安货币市场基金（A 级基金份额代码：320002，B 级基金份额代码：320019）、诺安先锋混合型证券投资基金（基金代码：320003）、诺安优化收益债券型证券投资基金（基金代码：320004）、诺安价值增长混合型证券投资基金（基金代码：320005）、诺安灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：320006）、诺安成长混合型证券投资基金（基金代码：320007）、诺安增利债券型证券投资基金（A 级基金份额代码：320008，B 级基金份额代码：320009）、诺安中小盘精选混合型证券投资基金（基金代码：320011）、诺安主题精选混合型证券投资基金（基金代码：320012）、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金（A 类基金代码：320014；C 类基金代码：010352）、诺安行业轮动混合型证券投资基金（基金代码：320015）、诺安多策略混合型证券投资基金（基金代码：320016）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：320018）、诺安策略精选股票型证券投资基金（基金代码：320020）、诺安双利债券型发起式证券投资基金（基金代码：320021）、诺安研究精选股票型证券投资基金（基金代码：320022）、诺安鸿鑫混合型证券投资基金（基金代码：000066）、诺安天天宝货币市场基金（A 类基金代码：000559，E 类基金代码：000560）、诺安理财宝货币市场基金（A 类份额基金代码：000640）、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金代码：000538；C 类基金代码：002053）、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金代码：000714；C 类基金代码：002052）、诺安聚鑫宝货币市场基金（A 类基金代码：000771）、诺安聚利债券型证券投资基金（A 类基金代码：000736，C 类基金代码：000737）、诺安新经济股票型证券投资基金（基金代码：000971）、诺安低碳经济股票型证券投资基金（A 类基金代码：001208；C 类基金代码：010349）、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类基金代码：001351；C 类基金代码：010355）、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金代码：001411；C 类基金代码：002051）、诺安先进制造股票型证券投资基金（基金代码：001528）、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：002137）、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：002145）、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：002292）、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代

码：002291）、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：002560）、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：001706）、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：001743）、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：001744）、诺安高端制造股票型证券投资基金（基金代码：001707）、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：001780）、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金（A 类基金代码：005901；C 类基金代码：005902）、诺安积极配置混合型证券投资基金（A 类基金代码：006007；C 类基金代码：006008）、诺安优化配置混合型证券投资基金（基金代码：006025）、诺安精选价值混合型证券投资基金（基金代码：001900）、诺安鼎利混合型证券投资基金（A 类基金代码：006005，C 类基金代码：006006）、诺安恒鑫混合型证券投资基金（基金代码：006429）、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金（A 类基金代码：005448；C 类基金代码：005480）、诺安新兴产业混合型证券投资基金（基金代码：008328）、诺安研究优选混合型证券投资基金（基金代码：008185）等之间的转换业务。

#### （一）、基金转换费用

基金转换费由转出基金的赎回费以及相应的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

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。

当转入基金的适用申购费率高于转出基金的适用申购费率时，将收取申购费补差，即“申购费补差费率=转入基金的适用申购费率-转出基金的适用申购费率”；当转入基金的适用申购费率等于或低于转出基金的适用申购费率时，不收取申购费补差。

#### （二）、转换份额计算公式

计算公式如下： $A = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + F] / E$

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；G 为申购费补差费率；E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；F 为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计未付收益（仅限转出基金为货币市场基金）。具体份额

以注册登记机构的记录为准。转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

**例 1：诺安优化收益债券 50000 份转换为诺安中证 100 指数 A**

假设某投资者在某代销机构购买了 5 万份诺安优化收益债券，至 T 日其持有期不少于 7 日但未满 31 个自然日，希望在 T 日全部转换为诺安中证 100 指数 A。

T 日，诺安优化收益债券的净值为 1.1000，赎回费率为 0.50%，适用申购费率为 0；诺安中证 100 指数 A 的净值为 1.2000，T 日该代销机构的适用申购费率为 1.20%。则计算如下：

$1.20\% > 0$ ，收取申购费补差，申购费补差费率 =  $1.20\% - 0 = 1.20\%$

转入诺安中证 100 指数 A 的基金份额 = 转出诺安优化收益债券的基金份额  $\times$  T 日诺安优化收益债券的净值  $\times$  (1 - 诺安优化收益债券的赎回费率)  $\div$  (1 + 申购费补差费率)  $\div$  T 日诺安中证 100 指数 A 的净值 =  $50000 \times 1.1000 \times (1 - 0.50\%) \div (1 + 1.20\%) \div 1.2000 = 45063.41$  份

**例 2：诺安中证 100 指数 A 50000 份转换为诺安货币**

假设某投资者在某代销机构购买了 5 万份诺安中证 100 指数 A，至 T 日其持有期不少于 7 日但未满两年，希望在 T 日全部转换为诺安货币。

T 日，诺安中证 100 指数 A 的净值为 1.2000，赎回费率为 0.50%，T 日该代销机构的适用申购费率为 1.20%。则计算如下：

因诺安货币的申购费率为 0，低于 1.20%，故本次转换不收取申购费补差（即申购费补差费率为 0）；而诺安货币的面值（即净值）为 1.0000。

转入诺安货币的基金份额 = 转出诺安中证 100 指数 A 的基金份额  $\times$  T 日诺安中证 100 指数 A 的净值  $\times$  (1 - 诺安中证 100 指数 A 的赎回费率)  $\div$  (1 + 申购费补差费率)  $\div$  T 日诺安货币的净值 =  $50000 \times 1.20 \times (1 - 0.50\%) \div (1 + 0) \div 1 = 59700.00$  份

### 十三、 转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### 十四、 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，扣款的金额及业务规则遵循各销售机构的规定，具体内容投资者可查阅相关销售机构定期定额投资业务的公告。

#### 十五、 基金的非交易过户

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。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。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的情形；“司法执行”是指司法机关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《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

#### 十六、 基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。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、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金实施被动式投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

### 二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股（如首次公开发行或增发）、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。

本基金投资于股票组合的比例为基金资产净值的 90%-95%，其中投资于相关标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

此外，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。

### 三、投资理念

与主动式投资相比较，被动式投资有着运营成本较低、投资透明化等优点，本基金秉承被动式投资理念，以跟踪中证 100 指数为投资原则，通过投资于同时具备较强市值代表性、较高流动性以及大盘蓝筹等特征的中证 100 指数成份股，力求获得该指数所代表的中国证券市场的平均收益，使投资者可以分享中国经济的长期增长。

### 四、投资策略

本基金采用完全复制策略，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

#### 1、股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照成份股在基准指数中证 100 指数

中的基准权重构建股票投资组合。

当发生下列特殊情况时：

（1）因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；

（2）预期标的指数的成份股即将调整；

（3）存在其他影响指数复制的因素。

基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，对本基金投资组合进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，获得更接近基准指数的收益率。

## 2、股票投资组合调整

（1）因基准指数成份股变动进行的调整

### ①定期调整

本基金股票指数化投资组合将根据基准指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法，以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

### ②不定期调整

当上市公司发生增发、配股、公司合并等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

当指数成份股权重发生变动时，对因股票停牌而无法交易的股票，本基金将用现金进行正向或逆向替代，待股票复牌后进行相应调整。

成份股在基准指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

（2）其他因素引起的调整

### ①新股因素

本基金将根据市场情况，决定是否参加首次公开发行（或增发）的新股市值配售与认购，由此得到的非基准指数成份股将在其规定持有期之后的 30 个交易日以内卖出；

### ②投资比例限制因素

根据法律法规中针对基金投资比例的限制规定，当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过法律法规的规定限制时，本基金将对投资

组合进行相应调整，以保证基金投资行为的合法合规性；

### ③申购、赎回因素

本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，以保证基金正常运行从而有效跟踪标的指数；

### ④法律法规因素

对于基金管理人、托管人和与其有控股关系的股东发行或者承销的基准指数成份股，法律法规禁止投资而本基金无法获得豁免的，将用技术方法对其进行替换。

## 3、 现金管理

现金管理是指数基金投资管理的一个重要环节，主要由三方面内容组成：现金流预测、现金持有比例管理以及现金资产收益管理。

## 五、 标的指数和业绩比较基准

### 1、 标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证 100 指数。

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股，综合反映了沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。其流动性高，可投资性强，适合作为本基金的标的指数。

如果中证指数有限公司变更或停止中证 100 指数的编制及发布、或中证 100 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中证 100 指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他更适合投资的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，变更本基金的标的指数，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

### 2、 业绩比较基准

中证 100 指数收益率×95%+ 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在履行适当程序后，变更业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

## 六、 风险收益特征



本基金为股票型指数基金，可获取资本市场平均收益率，其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金。

## 七、投资决策

### （一）决策依据

- 1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；
- 2、本基金采取指数化投资方式，在追求指数偏离度和跟踪误差最小的前提下，相关人员会对标的指数的成份股构成和权重变化进行研究，形成研究结论，从而提供给投资委员会作为决策依据。

### （二）决策程序

- 1、投资决策支持：研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究和外部机构报告，向投资决策委员会提出宏观分析和投资策略报告，并且由于本基金采取指数化投资方式，金融工程小组还会根据标的指数的成份股构成和权重状况，形成投资建议，提供给投资决策委员会作为参考。
- 2、投资原则的制定：投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的情况下，根据研究人员和基金经理的有关报告，决定基金投资的主要原则，对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。
- 3、研究支持：研究分析人员根据投资决策委员会的决议，为基金经理提供各类分析报告和投资建议；也可根据基金经理的要求进行有关的研究。
- 4、制定投资决策：基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则，根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。
- 5、风险控制与评估：风险控制办公会定期召开会议，听取投资管理部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估，并提出风险控制意见。
- 6、组合的调整：基金经理有权根据环境的变化和实际的需要，在其权限范围内对组合进行调整，超出其权限的调整，需报投资决策委员会审批。

## 八、投资限制

### （一）投资禁止

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；

- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- 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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

## （二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、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%；

2、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述关于可流通股票比例的限制；

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

4、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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%；

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

9、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

10、本基金应在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；

11、本基金主动投资于流动性受限资产（流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等）的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

12、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；

13、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除上述第 11、12 项另有约定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。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上述第 11 项所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

## 九、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、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；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

## 十、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2020 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### （一）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	287,272,177.82	93.61
	其中：股票	287,272,177.82	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,246,033.30	6.27
8	其他资产	362,592.00	0.12
9	合计	306,880,803.12	100.00

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,237,044.00	1.71
B	采矿业	7,838,540.70	2.56
C	制造业	117,086,830.94	38.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,941,142.10	1.94
E	建筑业	6,625,692.43	2.17

F	批发和零售业	1,751,033.13	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	7,100,430.53	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,916,450.10	0.95
J	金融业	105,492,676.40	34.50
K	房地产业	10,816,236.02	3.54
L	租赁和商务服务业	7,849,695.80	2.57
M	科学研究和技术服务业	2,787,190.00	0.91
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	593,866.00	0.19
Q	卫生和社会工作	2,756,112.00	0.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	284,792,940.15	93.15

## 2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,356,719.32	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	11,470.24	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	15,608.70	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,666.41	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,886.06	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,044.42	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,479,237.67	0.81

### （三）报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票

#### 投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	293,278	22,365,380.28	7.32

2	600519	贵州茅台	13,307	22,202,729.50	7.26
3	000858	五粮液	51,612	11,406,252.00	3.73
4	600036	招商银行	277,297	9,982,692.00	3.27
5	000333	美的集团	131,669	9,559,169.40	3.13
6	600276	恒瑞医药	98,501	8,847,359.82	2.89
7	000651	格力电器	132,421	7,058,039.30	2.31
8	600030	中信证券	225,702	6,777,831.06	2.22
9	600887	伊利股份	162,143	6,242,505.50	2.04
10	002475	立讯精密	109,068	6,231,054.84	2.04

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

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	300999	金龙鱼	15,747	404,697.90	0.13
2	688256	寒武纪	2,757	334,313.82	0.11
3	688567	孚能科技	13,710	308,200.80	0.10
4	688520	神州细胞	5,489	305,901.97	0.10
5	688505	复旦张江	10,687	230,518.59	0.08

(五) 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。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八) 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。

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### （十一）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### （十二）投资组合报告附注

1、本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

##### 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,956.36
2	应收证券清算款	166,937.13
3	应收股利	-
4	应收利息	2,069.26
5	应收申购款	150,629.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	362,592.00

##### 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债券。

##### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

###### （1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

###### （2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	---------------	----------

1	300999	金龙鱼	404,697.90	0.13	新股流通受限
2	688256	寒武纪	334,313.82	0.11	新股流通受限
3	688567	孚能科技	308,200.80	0.10	新股流通受限
4	688520	神州细胞	305,901.97	0.10	新股流通受限
5	688505	复旦张江	230,518.59	0.08	新股流通受限

(3) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。



## 第九部分 基金的业绩

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

### 一、自基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

诺安中证 100 指数 A

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
2009.10.27~2009.12.31	0.10%	1.06%	3.52%	1.65%	-3.42%	-0.59%
2010.01.01~2010.12.31	-18.48%	1.51%	-18.22%	1.50%	-0.26%	0.01%
2011.01.01~2011.12.31	-19.12%	1.17%	-19.70%	1.20%	0.58%	-0.03%
2012.01.01~2012.12.31	11.52%	1.15%	10.48%	1.16%	1.04%	-0.01%
2013.01.01~2013.12.31	-10.33%	1.38%	-12.27%	1.38%	1.94%	0.00%
2014.01.01~2014.12.31	59.24%	1.28%	56.35%	1.26%	2.89%	0.02%
2015.01.01~2015.12.31	0.19%	2.38%	0.98%	2.34%	0.79%	0.04%
2016.01.01~2016.12.31	-5.62%	1.25%	-6.98%	1.19%	1.36%	0.06%
2017.01.01~2017.12.31	36.16%	0.67%	28.63%	0.65%	7.53%	0.02%
2018.01.01~2018.12.31	-18.32%	1.28%	-20.82%	1.30%	2.50%	-0.02%
2019.01.01~2019.12.31	44.87%	1.18%	33.71%	1.18%	11.16%	0.00%
2020.01.01~2020.09.30	20.76%	1.40%	7.03%	1.44%	13.73%	-0.04%
2009.10.27~2020.09.30	92.62%	1.38%	38.31%	1.38%	54.31%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%

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

### 诺安中证100指数 A



注：

本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

其构成主要有：

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记人自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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资产。

非因本基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。基金管理人、基金托管人、基金注册登记人和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、估值日

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

### 三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

## 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、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、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。

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

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

## 四、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

## 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 六、基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；估值错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记人、或代理销售机构、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的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

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

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，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

未及时发现已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其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资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、基金合同或其他规定，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损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；



（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

## 七、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会认定的其他情形。

## 八、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

## 第十二部分 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、基金收益分配原则

1、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六次，每次分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；并且红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间应不超过 15 个工作日；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资者可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值：即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规的前提下，基金管理人、注册登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、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。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，基金管理人按法律法规的规定在指定媒介公告。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
  - 2、基金托管人的托管费；
  - 3、基金的销售服务费；
  - 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
  - 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
  - 6、基金份额持有人大会费用；
  - 7、基金的证券交易费用；
  - 8、基金的银行汇划费用；
  - 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 二、与基金运作有关的费用

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

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

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率、基金销售服务费率，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前根据《信息披露办法》的规定在指定媒介公告新费率。

## **五、基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

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

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定的互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。



## 五、公开披露的基金信息

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、基金产品资料概要

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

1、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

#### （四）基金净值信息

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过其指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产

生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；

- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （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备案，并予以公告。

#### （十）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

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

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

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

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

## 第十六部分 风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

### 一、市场系统性风险

本基金投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金资产产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。证券市场中这种不能通过分散化投资而消除的风险，称为市场系统性风险。

### 二、上市公司风险

市场中可能存在公司质量迅速恶化的上市公司，针对可能投资此类股票而产生的风险，本基金采取分散化投资策略，从而降低少数出现问题的上市公司对基金资产的影响。

### 三、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，同时也影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券和股票，因此基金的收益水平会受到利率变化的影响。

### 四、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 五、管理风险

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

2、基金管理人和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。

### 六、产品特有风险

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法跟踪标的指数，在大多数情况之下，本基金将维持较高的股票投资比例。在市场下跌的时候，可能面临基金净值和指数同步下跌的风险。

## 七、跟踪误差风险

尽管基金管理人将严控风险，尽力减少基金组合与标的指数间的偏离度，但由于法律法规的限制，本基金不能投资于部分标的指数的成份股，并且基金运作中也会产生管理及交易等费用，所以本基金的每日收益率不可避免的与指数收益率发生偏离，产生跟踪误差风险。

## 八、其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

## 第十七部分 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、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：
  - （1）更换基金管理人；
  - （2）更换基金托管人；
  - （3）转换基金运作方式；
  - （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
  - （5）变更基金类别；
  - （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - （7）本基金与其他基金的合并；
  - （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
  - （9）终止《基金合同》；
  - （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自变更后的《基金合同》生效之日起在指定媒介公告。

### 二、 基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：



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

### 三、基金财产清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### 四、清算费用

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

### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金

财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十八部分 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利和义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1） 依法募集基金；
- （2） 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3） 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4） 销售基金份额；
- （5） 召集基金份额持有人大会；
- （6） 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7） 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8） 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- （9） 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10） 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11） 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12） 在符合有关法律规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- （13） 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；
- （14） 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；
- （15） 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

实施其他法律行为；

（16）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；

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金

法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

（22）如基金管理人依法将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在

基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

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

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

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

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，

确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）复核、审查基金清算报告，参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 复核、审查基金管理人更新的基金产品资料概要、招募说明书；

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

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人的权利与义务**

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

本基金同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(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、基金销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。



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

- （1） 遵守《基金合同》；
- （2） 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （3） 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （4） 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （5） 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- （6） 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （7） 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的同一类别的每一基金份额拥有平等的投票权。

### （一）召开事由

- 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
  - （1） 终止《基金合同》；
  - （2） 更换基金管理人；
  - （3） 更换基金托管人；
  - （4） 转换基金运作方式；
  - （5） 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
  - （6） 变更基金类别；
  - （7） 本基金与其他基金的合并；
  - （8） 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - （9） 变更基金份额持有人大会程序；
  - （10） 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
  - （11） 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金

份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

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

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托书的内容要求（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；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

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

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持

有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原

则对提案进行审核：

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

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

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

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名

（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人经通知拒不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## 三、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、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止《基金合同》；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## （二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新

基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。
- （7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### **（六）基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### **四、争议的处理和适用的法律**

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### **五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 第十九部分 基金托管协议摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：诺安基金基金管理有限公司

住所：广东省深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

法定代表人：秦维舟

成立时间：2003 年 12 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]132 号

注册资本：人民币 1.5 亿元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：0755-83026688

传真：0755-83026677

联系人：陈阳

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：蒋松云

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

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

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据

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

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股（如首次公开发行或增发）、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。

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

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于股票组合的比例为基金资产净值的 90%-95%，其中投资于相关标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。基金持

有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

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

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

a、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%；

b、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述关于可流通股票比例的限制；

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

d、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

e、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%；

f、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%；

g、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%；

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

i、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

j、本基金应在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；

k、本基金主动投资于流动性受限资产（流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等）的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

l、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；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

m、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第 k、l 项另有约定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

### （4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

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

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法



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

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

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

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，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。

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

（2）基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

（3）基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协

商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

#### 6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

#### 7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

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

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

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上

述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

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

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、各类基金份额累计净值计算、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。

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

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

致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额累计净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予以协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行

业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的诺安基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### （三）基金的银行账户的开立和管理

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

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

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

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

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

### （五）债券托管账户的开立和管理

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

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

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

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值、基金份额净值的计算

##### 1、基金资产净值、基金份额净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日该类基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金

资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外予以公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，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予以公布。

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所



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

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

(4) 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) 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。

(7) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

（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。

### （三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，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，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

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

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

### （四）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时

查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

《基金合同》生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在指定网站上；基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个月日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个半月内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议的处理和适用的法律

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

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

有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

### （二）基金财产的清算

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

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 5、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 基金清算组作出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算公告；
- (9) 对基金财产进行分配。

#### 6、清算费用

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

#### 7、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 第二十部分 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，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、公开信息披露服务

- 1、披露公司（基金管理人）信息；
- 2、披露基金信息；
- 3、其他信息的披露。

### 二、对账服务

- 1、对账信息；
- 2、其他资料。

### 三、查询服务

#### 1、账户信息查询

对于基金管理人所管理基金的基金份额持有人，基金管理人都会给予其唯一的客户服务账户及初始密码。为了持有人方便起见，客户服务账户将和客户基金账户唯一对应。基金份额持有人在客户服务中心和基金管理人网站都可以凭借客户服务账户、基金账户或身份证号进入本人的账户，了解账户信息，包括本人的基本资料、基金品种、基金份额、基金投资收益率等。

#### 2、客户账户信息的修改

基金份额持有人可以直接登陆基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务中心，由服务人员提供相关服务。为了维护客户的利益，客户重要信息的更改由基金份额持有人亲自到指定的基金销售网点进行。

#### 3、信息定制

基金份额持有人可以在基金管理人网站定制自己所需要的信息，包括基金管理人新闻、市场行情、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求将定期或不定期向客户发送信息，客户也可以直接登陆基金管理人网站浏览相关信息。如果客户不需要或需要调整，也可以直接在线修改和调整。

### 四、基金投资的服务

1、免费红利再投资服务；

2、定期定额计划服务：

（1）基金管理人通过直销网上交易系统为投资者办理定期定额投资业务，具体开始或结束办理的时间和规则请查阅本基金管理人相关公告。

（2）投资者可通过部分代销机构办理定期定额投资业务，通过代销机构办理基金定投业务开始或结束办理的时间和规则以代销机构的有关规定为准。

## 五、投诉管理与建议受理服务

基金管理人的投诉管理与建议受理服务由客户服务中心统一管理，投诉人可以通过基金管理人客服热线、在线客服、客服邮箱等渠道对基金管理人所提供的服务进行投诉或提出建议。

诺安基金管理有限公司全国统一客户服务电话：400-888-8998

诺安基金管理有限公司网址：[www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn)

诺安基金管理有限公司客服邮箱：[services@lionfund.com.cn](mailto:services@lionfund.com.cn)



## 第二十一部分 其他应披露事项

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-4-30
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐商银行基金费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-5-6
3	诺安基金管理有限公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-5-20
4	诺安基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-5-21
5	诺安基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票云南白药估值调整的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-5-21
6	诺安基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-5-29
7	诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）2019 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2019-6-11
8	诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）2019 年第 1 期-摘要	《中国证券报》	2019-6-11
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-6-21
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金定投业务费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-6-27
11	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019-7-1
12	诺安基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	基金管理人网站	2019-7-1
13	诺安基金管理有限公司关于华侨永亨银行不再代销旗下部分基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、	2019-7-16

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
		《中国证券报》、 《证券日报》	
14	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2019-7-16
15	诺安基金管理有限公司关于增加中天证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-8-14
16	诺安基金管理有限公司关于董事长代为履行总经理职务的公告	《中国证券报》	2019-8-22
17	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年半年度报告	基金管理人网站	2020-8-23
18	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	《中国证券报》	2020-8-23
19	诺安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《中国证券报》	2019-8-28
20	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-9-5
21	诺安基金管理有限公司关于调整旗下基金在招商银行首次申购、追加申购起点金额及最低持有份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-9-18
22	诺安基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-10-11
23	诺安基金管理有限公司关于增加福建海峡银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2019-10-23
24	诺安基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-10-25
25	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2019-10-25
26	诺安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过凤凰金信办理申购、定投业务起点金额、最低赎回（保有）份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-11-6
27	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员	《证券时报》、	2019-11-9

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
	的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	
28	诺安基金管理有限公司关于总经理代任和离任的公告	《中国证券报》	2019-11-23
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券为代销机构并开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-10
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源证券基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-10
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“安基金管倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-28
32	诺安基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-28
33	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-31
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加昆仑银行基金费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-31
35	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-31
36	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加烟台银行基金定投申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2019-12-31
37	诺安基金管理有限公司关于总经理任职的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-1-4
38	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在北京农村商业银行股份有限公司开通定投、转换业务	《证券时报》、 《上海证券报》、	2020-1-6

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
	及开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	
39	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在国金证券开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-1-8
40	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券开通定投、转换业务及开展费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-1-9
41	诺安基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-1-20
42	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2020-1-20
43	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-1-21
44	诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同	基金管理人网站	2020-1-21
45	诺安中证 100 指数证券投资基金托管协议	基金管理人网站	2020-1-21
46	诺安基金管理有限公司关于旗下基金延迟开市的提示性公告	基金管理人网站	2020-1-31
47	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》更新招募说明书的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-2-3
48	诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）2020 年第 1 期-正文	基金管理人网站	2020-2-3
49	诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）2020 年第 1 期-摘要	基金管理人网站	2020-2-3
50	诺安基金管理有限公司关于旗下基金延迟开市的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-2-3
51	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券为代销机构的公告	《中国证券报》	2020-2-12
52	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在国元证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-2-26

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
53	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙商证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-2-27
54	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万家财富开展的基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-2
55	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2020-3-3
56	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银河证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-4
57	诺安中证 100 指数证券投资基金 2020 年度第一次分红公告	《中国证券报》	2020-3-4
58	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-11
59	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信期货开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-17
60	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券（山东）开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-17
61	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-17
62	诺安基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-21
63	诺安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-23
64	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信建投证券开通定投、转换业务并参加基金费	《证券时报》、 《上海证券报》、	2020-3-23

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
	率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	
65	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大连网金基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-3-25
66	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中宏人寿保险开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020-4-1
67	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在爱建证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-2
68	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-2
69	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在方正证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-21
70	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在华安证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-21
71	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-22
72	诺安中证 100 指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2020-4-22
73	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开展基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020-4-23
74	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海银行开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-24
75	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在宁波银行开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-24
76	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并开通定	《证券时报》、 《上海证券报》、	2020-4-24

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
	投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	
77	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加中国民生银行直销银行基金通平台费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-24
78	诺安基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-4-30
79	诺安中证 100 指数证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站	2020-4-30
80	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南为代销机构的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2020-5-8
81	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020-5-12
82	诺安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《中国证券报》	2020-5-15
83	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加汇成基金开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-5-20
84	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-12
85	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京度小满基金销售有限公司开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-22
86	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在汇成基金开通定投、转换业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-23
87	诺安基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用诺安基金名义进行诈骗活动的提示性公告	《中国证券报》	2020-6-23
88	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在德邦证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-24

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
89	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在万家财富开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-24
90	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在乾道盈泰开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-29
91	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定投申购手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-6-30
92	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-7-1
93	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在海通证券开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-7-14
94	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-7-21
95	诺安中证 100 指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	基金管理人网站	2020-7-21
96	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在南京银行开通定投、转换业务并参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-7-24
97	诺安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《中国证券报》	2020-8-7
98	诺安基金管理有限公司关于深圳办公地址临时变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-8-8
99	诺安基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-8-8
100	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在同花顺开通定投及转换业务并参加同花顺开展的基金定投费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-8-10



序号	公告事项	披露媒介	披露日期
		《证券日报》	
101	诺安基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要的提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-8-24
102	诺安中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2020-8-24
103	诺安基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用诺安基金名义进行诈骗活动的提示性公告	《中国证券报》	2020-8-28
104	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-8-31
105	诺安中证 100 指数证券投资基金 2020 年中期报告	基金管理人网站	2020-8-31
106	诺安基金管理有限公司关于在直销网上平台开通汇款交易业务并开展基金申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-9-15
107	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券开展的基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-10-23
108	诺安基金管理有限公司关于旗下 5 只基金新增基金份额类别并修改基金合同、托管协议部分条款的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2020-10-26
109	诺安基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2020-10-28
110	诺安中证 100 指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	基金管理人网站	2020-10-28
111	诺安基金管理有限公司关于旗下 5 只基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2020-10-29
112	诺安中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）2020 年第 2 期	基金管理人网站	2020-10-29
113	诺安中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2020-10-29
114	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中天证券开通定投、转换业务并参加中天证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2020-11-2

序号	公告事项	披露媒介	披露日期
		《证券日报》	

注：上述公告同时在本公司网站[[www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn)]及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露。

## 第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 第二十三部分 备查文件

- 一、 中国证监会核准诺安中证 100 指数证券投资基金募集的文件
- 二、 《诺安中证 100 指数证券投资基金基金合同》
- 三、 《诺安中证 100 指数证券投资基金托管协议》
- 四、 法律意见书
- 五、 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、 基金托管人业务资格批件和营业执照