

富国中证国有企业改革指数型证券投资基金 招募说明书（更新）

（由富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金
终止分级运作变更而来）

（二〇二一年第二号）

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

富国中证国有企业改革指数型证券投资基金由富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金经中国证监会《关于准予富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2014】1206号）注册。富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，基金管理人为富国基金管理有限公司、基金托管人为中国农业银行股份有限公司。基金管理人于2014年12月17日获得中国证监会的书面确认，富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同自该日起生效。

根据《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》约定，富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止富国国企改革A份额与富国国企改革B份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于2020年12月2日在规定媒介发布《关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于2020年12月31日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

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

本基金标的指数为中证国有企业改革指数，指数简称国企改革。指数代码：399974。标的指数以2004年12月31日为基日，以1000点为基点。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司官方网站，网址：www.csindex.com.cn。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分

考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。

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

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

本次招募说明书更新内容为：

序号	章节	更新内容
1	重要提示	增加存托凭证、《指数基金指引》相关内容
2	第一部分 绪言	增加《指数基金指引》相关内容
3	第二部分 释义	更新法规
4	第十一部分 基金的投资	增加存托凭证、《指数基金指引》的相关内容
5	第十四部分 基金资产的	增加存托凭证估值相关内容

序号	章节	更新内容
	估值	
6	第十八部分 基金的信息披露	增加存托凭证投资信息披露的内容
7	第十九部分 风险揭示	增加存托凭证、《指数基金指引》涉及的特别风险
8	第二十二部分 基金托管协议的内容摘要	增加存托凭证的相关内容

目录

第一部分 绪言	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 基金管理人.....	8
第四部分 基金托管人.....	22
第五部分 相关服务机构.....	25
第六部分 基金的历史沿革.....	46
第七部分 基金的存续.....	47
第八部分 基金份额的上市交易.....	48
第九部分 基金份额的申购与赎回.....	49
第十部分 基金份额的登记、转托管及其他业务.....	61
第十一部分 基金的投资.....	63
第十二部分 基金的业绩.....	78
第十三部分 基金的财产.....	80
第十四部分 基金资产的估值.....	81
第十五部分 基金的收益与分配.....	87
第十六部分 基金费用与税收.....	89
第十七部分 基金的会计与审计.....	92
第十八部分 基金的信息披露.....	93
第十九部分 风险揭示.....	99
第二十部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	107
第二十一部分 基金合同的内容摘要.....	110
第二十二部分 基金托管协议的内容摘要.....	127

第二十三部分 对基金份额持有人的服务.....	140
第二十四部分 其他应披露事项.....	142
第二十五部分 招募说明书存放及其查阅方式.....	145
第二十六部分 备查文件.....	146

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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定，以及《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了富国中证国有企业改革指数型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载内容、误导性陈述或重大遗漏，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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的基本法律文件。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指富国中证国有企业改革指数型证券投资基金，由富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来

2、基金管理人：指富国基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同：指《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、《上市交易公告书》：指《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金上市交易公告书》

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

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》

修正的《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

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《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

14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外投资者：指《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（及颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，经中国证监会批准，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

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

24、销售机构：指直销机构和代销机构

25、直销机构：指富国基金管理有限公司

26、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

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

29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为富国基金管理有限公司或接受富国基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

30、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

31、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理基金交易业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

32、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

33、基金合同生效日：指《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》生效日，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》自同一日失效

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

- 35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 37、T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日
- 38、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 39、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 40、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 41、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订，以及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则
- 42、申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 44、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
- 45、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管
- 46、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受理基金申购申请的一种投资方式
- 47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日全部基金份额的10%
- 48、元：指人民币元
- 49、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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

54、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

55、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，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

56、标的指数：指中证国有企业改革指数

57、日/天：指公历日

58、月：指公历月

59、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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

60、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额申购和赎回业务的基金销售机构和场所

61、场内：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易业务的场所

62、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

63、**证券登记结算系统**：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统

64、**上市交易**：基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖本基金相关份额的行为

65、**系统内转托管**：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

66、**跨系统转托管**：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

67、**不可抗力**：指基金合同当事人无法预见、无法避免且无法克服的客观事件

68、**基金产品资料概要**：指《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

成立日期：1999 年 4 月 13 日

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

电话：（021）20361818

联系人：赵瑛

注册资本：5.2 亿元人民币

股权结构（截止于 2020 年 10 月 31 日）：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设二十九个部门、三个分公司和二个子分公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、固定收益交易部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、养老

金业务部、银行业务部、机构服务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部（董事会办公室）、信息技术部、运营部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理（香港）有限公司、富国资产管理（上海）有限公司。

权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益投资部：负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分（包括公司自有资金等）的投资管理；固定收益专户投资部：负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理；固定收益信用研究部：建立和完善债券信用评级体系，开展信用研究等，为公司固定收益类投资决策提供研究支持；固定收益策略研究部：开展固定收益投资策略研究，统一固定收益投资中台管理，为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制；固定收益交易部：在公司投委会、分管领导授权范围内，负责审核并执行各固定收益投资组合指令，实现对投资交易一线风险控制的前提下，高效、公平地完成投资指令，并结合执行情况完成交易反馈；多元资产投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理；量化投资部：负责公司有关量化投资管理业务；海外权益投资部：负责公司在中国境外（含香港）的权益投资管理；权益专户投资部：负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理；养老金投资部：负责养老金（企业年金、职业年金、基本养老金、社保等）及类养老金专户等产品的投资管理；权益研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责除固定收益之外的各类投资交易和风险控制；机构业务部：负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金 FOF、海外客户等客群的销售与服务；养老金业务部：负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务；银行业务部：负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务；机构服务部：负责协调三个机构销售部门对接公司资源，实现项目落地，提供专业支持和项目管理，对公司已有机构客户进行持续专业服务；零售业务部：管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、

北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心，负责公募基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理，为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持；客户服务部：拟定客户服务策略，制定客户服务规范，建设客户服务团队，提高客户满意度，收集客户信息，分析客户需求，支持公司决策；电子商务部：负责基金电子商务发展趋势分析，拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则，有效推进公司电子商务业务；战略与产品部：负责开发、维护公募和非公募产品，协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略，建立数据搜集、分析平台，为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责，开展内部审计，管理信息披露、法律事务等；风险管理部：执行公司整体风险管理策略，牵头拟定公司风险管理制度与流程，组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对，负责公司旗下各投资组合合规监控等；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；综合管理部（董事会办公室）：负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司（内部）宣传、信息调研、行政后勤管理等工作；富国资产管理（香港）有限公司：证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；富国资产管理（上海）有限公司：经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

截止到 2020 年 10 月 31 日，公司有员工 518 人，其中 72%具有硕士学位。

二、 主要人员情况

（一） 董事会成员

裴长江先生，董事长，研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理。历任上海万国证券公司研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理，申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监，华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

陈戈先生，董事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司总经理。历任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、基金经

理、研究部总经理、总经理助理、副总经理，2005年4月至2014年4月任富国天益价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士 (Constance Mak)，董事，文学及商学学士，加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团亚洲业务总经理 (General Manager, Asia, International, BMO Financial Group)，中加贸易理事会董事和加拿大中文电视台顾问团的成员。历任 St. Margaret's College 教师，加拿大毕马威 (KPMG) 会计事务所的合伙人。

方荣义先生，董事，博士，高级会计师。现任申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官、财务总监、董事会秘书。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任，厦门大学工商管理教育中心副教授，中国人民银行深圳市中心支行会计处副处长，中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构监管处处长，中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长，申银万国证券股份有限公司财务总监。

张信军先生，董事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司财务总监、海通国际控股有限公司副总经理兼财务总监、海通国际证券非执行董事、海通银行非执行董事。历任海通证券有限公司计划财务部员工、计划财务部资产管理部副经理/经理、海通国际证券集团有限公司首席财务官、海通国际控股有限公司首席风险官。

吴惠明先生，董事，硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理。历任上海申银证券公司浦西管理总部交易部员工，申银万国证券股份有限公司经纪管理总部员工、办公室秘书、固定收益总部财务经理、党委办公室主任兼任党委组织部副部长、人力资源总部副总经理，申万宏源证券有限公司党建工作部/党委办公室主任。

Edgar Normund Legzdins 先生，董事，本科学历，加拿大特许会计师。现任 BMO 金融集团国际业务全球总裁 (SVP & Managing Director, International, BMO Financial Group)。1980年至1984年在 Coopers & Lybrand 担任审计工作；1984年加入加拿大 BMO 银行金融集团蒙特利尔银行。

王平先生，董事，硕士，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司财务总监。历任山东鲁信实业集团公司计划财务部副经理、经理，山东鲁信投资集

团股份有限公司、山东鲁信房地产投资开发有限公司财务部经理，鲁信创业投资集团股份有限公司财务总监，鲁信资本管理有限公司财务总监。

李彧先生，独立董事，研究生学历，高级经济师。现任上海紫江（集团）有限公司副董事长、执行副总裁，上海威尔泰工业自动化股份有限公司董事长，上海紫竹高新区（集团）有限公司副董事长。历任上海紫江（集团）有限公司研究室科长、总裁室经理、总裁特别助理、董事、副总裁，上海紫江企业集团股份有限公司董事长。

季文冠先生，独立董事，研究生学历。现任上海金融业联合会常务副理事长。历任上海仪器仪表研究所计划科副科长、办公室副主任、办公室主任、副所长；上海市浦东新区综合规划土地局办公室副主任、办公室主任、局长助理、副局长、党组副书记；上海市浦东新区政府办公室主任、外事办公室主任、区政府党组成员；上海市松江区区委常委、副区长；上海市金融服务办公室副主任、中共上海市金融工作委员会书记；上海市政协常委、上海市政协民族和宗教委员会主任。

李启安先生，独立董事，本科学历。现已退休。历任加拿大花旗银行副总裁，加拿大皇家地产服务有限公司亚洲业务发展部总监，MKI 集团有限公司（香港上市公司）执行董事，获多利金融服务有限公司（香港汇丰银行子公司）中国部高级副总裁，上海万都房产发展有限公司高级副总裁，香港大昌行集团有限公司（中信泰富集团子公司）集团财务总经理及曾派驻为上海总经理，香港汇丰银行私人银行部高级副总裁并派驻上海分行任财富管理总经理，香港万都集团有限公司执行董事及首席财务官。

刘江宁女士，独立董事，博士，副教授。现任对外经贸大学全球化与中国现代问题研究所研究员。历任山东财经大学教师。

（二）监事会成员

付吉广先生，监事长，硕士，高级经济师。现任山东省国际信托股份有限公司风控总监。历任济宁市信托投资公司投资部科员，济宁市留庄港运输总公司董事、副总经理，山东省国际信托投资有限公司投行业务部业务经理、副经理、稽核法律部副经理、经理、风险管理部经理，山东省中鲁远洋渔业股份有限公司财务总监，山东省国际信托有限公司信托业务四部经理。

曹志刚先生，监事，硕士。现任海通证券股份有限公司稽核部副总经理。历

任海通证券股份有限公司风险控制总部（稽核部）二级部经理、稽核部总经理助理。

孙兆军先生，监事，研究生学历。现任申万宏源证券有限公司法律合规总部副总经理（主持工作）。历任上海市经济工作党委副书记科员，上海市经济和信息化工作党委副书记科员、主任科员，上海证监局主任科员，兴业银行上海分行金融市场部业务经理，申银万国证券股份有限公司资产管理事业部产品评审总部副总经理，申万宏源证券有限公司资产管理事业部业务管理总部、业务拓展总部总经理、合规与风险管理中心副主任兼风险管理总部副总经理。

张晓燕女士，监事，博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行（中国）有限公司首席风险官。历任美国加州理工学院化学系研究员，加拿大多伦多大学化学系助理教授，蒙特利尔银行市场风险管理部模型发展和风险审查高级经理，蒙特利尔银行操作风险资本管理总监，道明证券交易风险管理部副总裁兼总监，华侨银行集团市场风险控制主管，新加坡交易所高级副总裁和风险管理部主管。

夏志辉先生，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司集中交易部投研中台总监兼高级金融平台研究经理。历任北京江河幕墙工程有限公司 ERP 部门系统管理员，上海霸才软件有限公司系统信息部系统管理员，上海绘梦视信息技术有限公司技术部数据库管理员，富国基金管理有限公司信息部高级系统管理员，光大保德信基金管理有限公司信息部主管，富国基金管理有限公司集中交易部风控总监助理兼高级风险管理经理、集中交易部风控副总监兼高级风险管理经理。

孙玉礼先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司权益投资部资深基金专员。历任美世咨询数据中心数据分析师，韬睿惠悦管理咨询（深圳）有限公司福利部精算顾问，上海泽奔商务咨询有限公司咨询顾问，富国基金管理有限公司高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理兼资深项目经理、基金专员。

程铖女士，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司机构服务部机构副总监兼资深项目经理。历任富国基金管理有限公司机构客户经理、高级机构客户经理、高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理。

黄奥博先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司战略与产品部产品总监兼资深产品经理。历任国联安基金管理有限公司产品部产品经理助理，

齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司产品部产品高级经理，富国基金管理有限公司产品经理、高级产品开发经理、资深产品开发经理。

（三）督察长

赵瑛女士，研究生学历，硕士学位。曾任职于海通证券有限公司国际业务部、上海国盛（集团）有限公司资产管理部/风险管理部、海通证券股份有限公司合规与风险管理总部、上海海通证券资产管理有限公司合规与风控部；2015年7月加入富国基金管理有限公司，历任监察稽核部总经理，现任富国基金管理有限公司督察长。

（四）经营管理层人员

陈戈先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

林志松先生，本科学历，工商管理硕士学位。曾任漳州进出口商品检验局秘书、晋江进出口商品检验局办事处负责人、厦门证券公司业务经理；1998年10月参与富国基金管理有限公司筹备，历任监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、部门经理、督察长，现任富国基金管理有限公司副总经理兼首席信息官。

陆文佳女士，研究生学历，硕士学位。曾任中国建设银行上海市分行职员，华安基金管理有限公司市场总监、副营销总裁；2014年5月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金管理有限公司副总经理。

李笑薇女士，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家教委外资贷款办公室项目官员，摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCI BARRA）BARRA 股票风险评估部高级研究员，巴克莱国际投资管理公司（Barclays Global Investors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009年6月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理、量化与海外投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，博士学位。2000年6月加入富国基金管理有限公司，历任产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理、权益投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

（五）本基金基金经理

（1）现任基金经理：

1) 王保合，博士，曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深 300 增强

证券投资基金基金经理助理；2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国创业板指数型证券投资基金）基金经理，2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为中证军工指数型证券投资基金）基金经理，2015年4月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为中证移动互联网指数型证券投资基金）、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证国有企业改革指数型证券投资基金）基金经理，2015年5月起任富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证全指证券公司指数型证券投资基金）、富国中证银行指数分级证券投资基金（已于2019年5月10日变更为富国中证银行指数型证券投资基金）基金经理，2017年9月至2019年10月任富国丰利增强债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年3月至2019年10月任富国中证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年9月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理；兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。

2) 张圣贤，硕士，自2007年7月至2015年3月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师；自2015年3月至2015年6月任富国基金管理有限公司基金经理助理；2015年6月起任富国中证军工指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证军工指数型证券投资基金）、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证国有企业改革指数型证券投资基金）、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证新能源汽车指数型证券投资基金）基金经理；自2015年8月起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证工业4.0指数型证券投资基金）、富国中证体育产业指数分级证券投资基金（已于2021年1月1日变更为富国中证体育产业指数型证券投资基金）

基金经理，2016年2月起任富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年7月至2020年12月任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2017年11月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理（已于2021年1月1日变更为富国中证煤炭指数型证券投资基金），2020年4月起任富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起担任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2020年12月起任富国中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资总监助理。具有基金从业资格。

（2）本基金历任基金经理：

章榭元先生自2014年12月至2015年5月担任本基金基金经理。

（六）投资决策委员会成员

公司投委会成员：总经理陈戈，分管副总经理朱少醒，分管副总经理李笑薇。

（七）其他

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

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

12、法律法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

四、 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

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

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

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反《基金合同》或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

五、 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、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活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、 基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、 基金管理人的风险管理和内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在的原因。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低的风险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1) 内部控制的原则

①全面性原则。内部控制制度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。

②独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核职能部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

③相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

④重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

(2) 内部控制的主要内容

①控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立有独立董事参加的风险委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会、风险控制委员会等委员会，分别负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

②风险评估

公司内部稽核人员定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度，并将评估报告报总经理办公会和风险控制委员会。

③操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

④信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保

证信息及时送达适当的人员进行处理。

⑤监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核职能部门，履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员具有相对的独立性，监察稽核报告提交全体董事审阅并报送中国证监会。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澎

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 550 只。

二、基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，

守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金销售机构

（一）直销机构

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

直销网点：直销中心

直销中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

客户服务统一咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-20513177

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

（二）场外代销机构

（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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法人代表：陈四清

联系人员：杨先生

客服电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法人代表：周慕冰

联系人员：贺倩

客服电话：95599

公司网站：www.abchina.com

（3）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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法人代表：刘连舸

联系人员：陈洪源

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（4）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法人代表：田国立

联系人员：张静

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

（5）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）自由贸易试验区银城中路 188 号

法人代表：任德奇

联系人员：王菁

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法人代表: 李建红

联系人员: 曾里南

客服电话: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(7) 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 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦

法人代表: 李庆萍

联系人员: 常振明

客服电话: 95558

公司网站: bank.ecitic.com

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市北京东路 689 号

法人代表: 吉晓辉

联系人员: 唐小姐

客服电话: 95528

公司网站: www.spdb.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区正义路 4 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法人代表: 董文标

联系人员: 杨成茜

客服电话: 95568

公司网站: www.cmbc.com.cn

(10) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号

法人代表: 李国华

联系人员: 王硕

客服电话: 95580

公司网站: www.psbc.com

(11) 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

法人代表: 吴建

联系人员: 郑鹏

客服电话: 95577

公司网站: www.hxb.com.cn

(12) 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法人代表: 肖遂宁

联系人员: 蔡宇洲

客服电话: 95511-3

公司网站: www.bank.pingan.com

(13) 东莞银行股份有限公司

注册地址: 东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址: 东莞市莞城区体育路 21 号

法人代表: 廖玉林

联系人员: 巫渝峰

客服电话: 0769-96228

公司网站: www.dongguanbank.cn

(14) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址: 东莞市莞城南城路 2 号

办公地址: 东莞市莞城南城路 2 号

法人代表: 何沛良

联系人员: 何茂才

客服电话: 0769-961122

公司网站: www.drcbank.com

(15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国 上海-自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法人代表: 杨德红

联系人员: 芮敏琪

客服电话: 400-8888-666/ 95521

公司网站: www.gtja.com

(16) 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

法人代表: 王常青

联系人员: 权唐

客服电话: 400-8888-108

公司网站: www.csc108.com

(17) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法人代表: 何如

联系人员: 周杨

客服电话: 95536

公司网站: www.guosen.com.cn

(18) 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 39—45 层

办公地址: 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法人代表: 宫少林

联系人员: 林生迎

客服电话: 95565、400-8888-111

公司网站: www.newone.com.cn

(19) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 8 号中信证券大厦

法人代表: 张佑君

联系人员: 顾凌

客服电话: 95548 或 4008895548

公司网站: www.cs.ecitic.com

(20) 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

法人代表: 陈有安

联系人员: 邓颜

客服电话: 4008-888-888

公司网站: www.chinastock.com.cn

(21) 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

法人代表: 周杰

联系人员: 李笑鸣

客服电话: 95553

公司网站: www.htsec.com

(22) 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

法人代表: 李梅

联系人员: 黄莹

客服电话: 95523 或 4008895523

公司网站: www.swhysc.com

(23) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址: 武汉新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表: 尤习贵

联系人员: 李良

客服电话: 95579 或 4008-888-999

公司网站: www.95579.com

(24) 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 楼、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 楼、28 层 A02 单元

法人代表: 牛冠兴

联系人员: 陈剑虹

客服电话: 400-800-1001

公司网站: www.essence.com.cn

(25) 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

法人代表: 余维佳

联系人员: 张煜

客服电话: 4008-096-096

公司网站: www.swsc.com.cn

(26) 民生证券股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层

法人代表: 余政

联系人员: 赵明

客服电话: 400-6198-888

公司网站: www.msza.com

(27) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法人代表: 周易

联系人员: 庞晓芸

客服电话: 95597

公司网站: www.htsc.com.cn

(28) 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 20 层

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

法人代表: 杨宝林

联系人员: 吴忠超

客服电话: 95548 或 400-889-5548

公司网站: www.zxzqsd.com.cn

(29) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法人代表: 张志刚

联系人员: 唐静

客服电话: 95321

公司网站: www.cindasc.com

(30) 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

法人代表: 薛峰

联系人员: 刘晨、李芳芳

客服电话: 95525

公司网站: www.ebscn.com

(31) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法人代表：杨宇翔

联系人员：吴琼

客服电话：95511-8

公司网站：stock.pingan.com

（32）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

法人代表：王少华

联系人员：黄静

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

（33）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 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

法人代表：杨炯洋

联系人员：谢国梅

客服电话：95584

公司网站：www.hx168.com.cn

（34）申万宏源西部证券有限公司

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

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

法人代表：许建平

联系人员：李巍

客服电话：4008-000-562

公司网站：www.hysec.com

(35) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市经七路 86 号

办公地址: 济南市经七路 86 号 23 层

法人代表: 李玮

联系人员: 吴阳

客服电话: 95538

公司网站: www.qlzq.com.cn

(36) 第一创业证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法人代表: 刘学民

联系人员: 吴军

客服电话: 95358

公司网站: www.firstcapital.com.cn

(37) 中航证券有限公司

注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表: 王宜四

联系人员: 戴蕾

客服电话: 400-8866-567

公司网站: www.avicsec.com

(38) 中国国际金融股份有限公司

注册地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 3 层

法人代表: 李剑阁

联系人员: 陶亭

客服电话: 010-65051166

公司网站: <http://www.cicc.com.cn>

(39) 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 28 层 A01、B01(b) 单元

法人代表: 俞洋

联系人员: 杨莉娟

客服电话: 95323

公司网站: <http://www.cfsc.com.cn/>

(40) 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 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11

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

法人代表: 高涛

联系人员: 张鹏

客服电话: 95532、400-600-8008

公司网站: www.china-invs.cn

(41) 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: 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法人代表: 祝献忠

联系人员: 李慧灵

客服电话: 400-898-9999

公司网站: www.hrsec.com.cn

(42) 天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法人代表: 余磊

联系人员: 杨晨

客服电话: 4008-005-000

公司网站: www.tfzq.com

（43）中信期货有限公司

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

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

法人代表：张皓

联系人员：韩钰

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

（44）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法人代表：张彦

联系人员：张燕

客服电话：400-166-1188

公司网站：<http://8.jrj.com.cn>

（45）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 799 号 3 号楼 5 层 01、02、
03 室

办公地址：上海浦东陆家嘴金融世纪广场 3 号楼 5F

法人代表：冷飞

联系人员：李娟

客服电话：021-50810673

公司网站：<http://www.wacaijijin.com/>

（46）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

法人代表：贲惠琴

联系人员：杨一新

客服电话: 021-50206003

公司网站: www.msftec.com

(47) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法人代表: 汪静波

联系人员: 张姚杰

客服电话: 400-821-5399

公司网站: www.noah-fund.com

(48) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法人代表: 薛峰

联系人员: 汤素娅

客服电话: 4006-788-887

公司网站: www.zlfund.cn

(49) 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 26 楼

法人代表: 其实

联系人员: 潘世友

客服电话: 400-1818-188

公司网站: www.1234567.com.cn

(50) 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: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法人代表: 杨文斌

联系人员: 张茹

客服电话: 4007-009-665

公司网站: www.ehowbuy.com

(51) 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文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法人代表: 陈柏青

联系人员: 张裕

客服电话: 4000-766-123

公司网站: www.fund123.cn

(52) 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

法人代表: 张跃伟

联系人员: 沈雯斌

客服电话: 400-089-1289

公司网站: www.erichfund.com

(53) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法人代表: 凌顺平

联系人员: 吴强

客服电话: 4008-773-772

公司网站: www.5ifund.com

(54) 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

法人代表: 沈继伟

联系人员: 曹怡晨

客服电话: 400-067-6266

公司网站: <http://a.leadfund.com.cn>

(55) 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 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

法人代表: 赵学军

联系人员: 张倩

客服电话: 400-021-8850

公司网站: www.harvestwm.cn

(56) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法人代表: 梁蓉

联系人员: 张旭

客服电话: 400-6262-818

公司网站: www.5irich.com

(57) 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

法人代表: 沈伟桦

联系人员: 程刚

客服电话: 400-609-9200

公司网站: www.yixinfund.com

(58) 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 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表: 钱燕飞

联系人员: 王锋

客服电话: 95177

公司网站: www.snjijin.com

(59) 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

法人代表: 李悦章

联系人员: 张林

客服电话: 400-066-8586

公司网站: <https://www.igesafe.com/>

(60) 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 5 层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法人代表: 周斌

联系人员: 马鹏程

客服电话: 400-786-8868

公司网站: www.chtwm.com

(61) 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 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法人代表: 王伟刚

联系人员: 丁向坤

客服电话: 400-619-9059

公司网站: www.hcjjjin.com

(62) 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

法人代表: 苗宏升

联系人员: 葛俏俏

客服电话: 4007-903-688

公司网站: www.fundying.com

(63) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址: 上海自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼

办公地址: 上海自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1108 室

法人代表: 申健

联系人员: 印强明

客服电话: 021-20292031

公司网站: <https://8.gw.com.cn/>

(64) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室

办公地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室、海淀北二街 10 号秦鹏大厦 12 层

法人代表: 张琪

联系人员: 付文红

客服电话: 010-62675369

公司网站: www.xincai.com

(65) 济安财富(北京)资本管理有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

法人代表: 杨健

联系人员: 李海燕

客服电话: 400-673-7010

公司网站: www.jianfortune.com

(66) 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 楼

法人代表: 燕斌

联系人员: 凌秋艳

客服电话: 400-046-6788

公司网站: www.66zichan.com

(67) 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: 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法人代表: 王翔

联系人员: 蓝杰

客服电话: 400-820-5369

公司网站: www.jiyufund.com.cn

(68) 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

法人代表: 陈继武

联系人员: 李晓明

客服电话: 4000-178-000

公司网站: www.lingxianfund.com

(69) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法人代表: 鲍东华

联系人员: 宁博宇

客服电话: 4008-219-031

公司网站: www.lufunds.com

(70) 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

法人代表: 肖雯

联系人员: 黄敏娥

客服电话: 020-89629066

公司网站: www.yingmi.cn

(71) 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: 北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法人代表: 彭运年

联系人员: 陈珍珍

客服电话: 400-8909-998

公司网站: www.jnlc.com

(72) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层

法人代表: 江卉

联系人员: 徐伯宇

客服电话: 95118

公司网站: <http://fund.jd.com/>

(73) 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202室

法人代表: 樊怀东

联系人员: 贾伟刚

客服电话: 4000-899-100

公司网站: www.yibaijin.com

(74) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋
3单元11层1108

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋
3单元11层1108

法人代表: 赖任军

联系人员: 刘昕霞

客服电话: 400-930-0660

公司网站：www.jfzinv.com

（75）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

办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507

法人代表：钟斐斐

联系人员：戚晓强

客服电话：400-618-518

公司网站：danjuanapp.com

（76）钱滚滚财富投资管理上海有限公司

注册地址：中国上海-自由贸易试验区陆家嘴环路333号729S

办公地址：上海市浦东新区商城路618号良友大厦B301-305室

法人代表：许欣

联系人员：屠帅颖

客服电话：400-700-9700

公司网站：www.qiangungun.com

（77）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

法人代表：李一梅

联系人员：仲秋月

客服电话：400-817-5666

公司网站：www.amcfortune.com

（三）场内销售机构

本基金办理场内销售业务的机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员。

（四）其他

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金销售机构，并在基金管理人网站公示。

二、 基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
电话：（010）50938782
传真：（010）50938991
联系人：赵亦清

三、 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：陈颖华
经办律师：黎明、陈颖华

四、 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所
注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

第六部分 基金的历史沿革

富国中证国有企业改革指数型证券投资基金由富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金经中国证监会《关于准予富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2014】1206号）注册。

富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金，基金管理人为富国基金管理有限公司、基金托管人为中国农业银行股份有限公司。基金管理人于 2014 年 12 月 17 日获得中国证监会的书面确认，富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同自该日起生效。

根据《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》约定，富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止富国国企改革 A 份额与富国国企改革 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在规定媒介发布《关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

第七部分 基金的存续

基金合同生效后的存续期内,连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

第八部分 基金份额的上市交易

一、基金份额的上市交易

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

二、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

三、上市交易的时间

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在规定媒介上刊登基金份额《上市交易公告书》。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。

五、上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

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

七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

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

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

第九部分 基金份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对基金份额进行申购与赎回。

一、 申购和赎回场所

投资者办理基金份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额场内申购、赎回业务。

投资者办理基金份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理基金份额场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

二、 申购和赎回的开放日及时间

1、 开放日及开放时间

深圳证券交易所、上海证券交易所的正常交易日为基金份额的申购、赎回开放日。场内业务办理时间为深圳证券交易所、上海证券交易所交易日交易时间，场外业务办理时间以各销售机构的规定为准，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

三、 申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回基金份额时按照登记机构登记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、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

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

四、 申购与赎回的程序

1、 申购和赎回的申请方式

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

投资者交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

2、申购和赎回申请的确认

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

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

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。若申购不成立或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

五、 申购和赎回的数量限制

1、投资者通过场外销售机构（不含直销网点）申购基金份额，单笔申购申请的最低金额为1元（含申购费）。通过基金管理人直销网点场外申购基金份额，单笔首次申购申请的最低金额为50,000元（含申购费），单笔追加申购申请的最低金额为20,000元（含申购费）；代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。通过基金管理人网上交易系统申购基金份额，单笔申购申请的最低金额为1元（含申购费）。基金管理人可根据市场情况，调整本基金申购的最低金额。本基金的场外销售机构可以根据各自的业务情况设置高于或等于基金管理人设定的上述单笔最低申购金额。投资者在场外销售机构办理本基金申购业务时，除需满足基金管理人最低申购金额限制外，当场外销售机构设

定的最低金额高于上述金额限制时，投资者还应遵循相关场外销售机构的业务规定。

投资者通过场内销售机构申购基金份额，单笔申购申请的最低金额为 10 元。

投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制。

3、基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，每次对基金份额的赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额不足 0.01 份的，在赎回时需一次全部赎回。但各代销机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

4、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、 基金的申购费和赎回费

1、本基金的申购费率由基金管理人决定，基金份额申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者申购本基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）场外申购费率

本基金对通过直销中心场外申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。本公司设定的养老金客户包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、养老目标基金、职业年金计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额M（含申购费）	申购费率
M<100万元	0.12%
100万元≤M<250万元	0.08%
250万元≤M<500万元	0.05%
M≥500万元	每笔1,000元

除上述养老金客户外，其他投资者申购本基金基金份额的场外申购费率见下表：

申购金额M（含申购费）	申购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M<250万元	0.80%
250万元≤M<500万元	0.50%
M≥500万元	每笔1,000元

（2）场内申购费率

本基金的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

2、赎回费率

本基金场内场外赎回费率见下表：

持有时间N	赎回费率
N<7日	1.50%
N≥7日	0.50%

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、当本基金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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低本基金的申购费率和赎回费率。

七、 申购和赎回的数额和价格

1、本基金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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、 申购份额的计算

1) 本基金的场外申购和场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

场内申购份额计算结果采用截位方式，保留至整数位，不足 1 份额对应的申购资金返还至投资者资金账户；场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者（非养老金客户）投资 100,000 元通过场外申购本基金基金份额，其对应申购费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.20\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.015 = 97,353.92 \text{ 份}$$

即投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,353.92 份基金份额。

例：某投资者（养老金客户）投资 100,000 元通过基金管理人直销中心场外申购本基金基金份额，其对应申购费率为 0.12%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.12\%) = 99,880.14 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,880.14 = 119.86 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,880.14 / 1.015 = 98,404.07 \text{ 份}$$

即投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 98,404.07 份基金份额。

例：某投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金基金份额，对应费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.20\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.015 = 97,353 \text{ 份（保留至整数位）}$$

$$\text{实际净申购金额} = 97,353 \times 1.015 = 98,813.30 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,813.30 - 1,185.77 = 0.93 \text{ 元}$$

即投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,353 份基金份额，申购费用为 1,185.77 元。

3、赎回金额的计算

本基金的场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式，赎回的计算公式为：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日的基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

以上计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者持有 100,000 份基金份额在场外赎回，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.015=101,500.00 元

赎回费用=101,500×0.50%=507.50 元

赎回金额=101,500-507.50=100,992.50 元

即投资者持有 100,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

例：某投资者持有 100,000 份基金份额在场内赎回，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.015=101,500 元

赎回费用=101,500×0.50%=507.5 元

赎回金额=101,500-507.5=100,992.50 元

即投资者持有 100,000 份基金份额在场内赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

八、 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形（除第 4、6 项外）之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者，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并予以公告。

发生上述第 4、6 项暂停申购情形之一的，为保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人有权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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，也可以采取上述措施对基金规模予以控制。

九、 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价

格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定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时，基金管理人应及时向中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在规定媒介上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日全部基金份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日全部基金份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并

处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过前一开放日全部基金份额的 10% 的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人可以对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人可以优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上刊登公告。基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在规定媒介上进行公告。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相应规则进行处理；基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

（3）暂停赎回：本基金连续 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，并应当在规定媒介公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

十一、 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近1个开放日的基金份额净值。

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

十二、 基金转换

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

十三、 定期定额投资计划

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

第十部分 基金份额的登记、转托管及其他业务

一、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

1、基金份额的登记

（1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的基金份额可以直接申请场内赎回，可以在本基金上市交易后在二级市场卖出，也可以在通过跨系统转托管转至注册登记系统后申请场外赎回。

（3）登记在注册登记系统中的基金份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统后申请场内赎回，或在本基金上市交易后在二级市场卖出。

2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

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

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回或基金份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

4、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

二、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者，或者是按照相关法律法规或国家有权机关要求的划转主体。

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

三、基金份额的冻结和解冻

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、符合法律法规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一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。

第十一部分 基金的投资

一、 投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国有企业改革指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

二、 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证国有企业改革指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

三、 投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在中证国有企业改革指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟

跟踪误差控制在 4%以内。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证国有企业改革指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证国有企业改革指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、股票投资组合构建

（1）组合构建方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现。

（2）组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证国有企业改革指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对股票投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与中证国有企业改革指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

①定期调整

根据中证国有企业改革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。

②不定期调整

A. 当上市公司发生增发、配股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；

B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪中证国有企业改革指数；

C. 根据法律、法规的规定，成份股在中证国有企业改革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。

3、存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

5、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

四、 投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

五、 投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1) 基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

(2) 投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4) 对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

六、 投资限制

1、 组合限制

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

(1) 本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中

投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

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

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

（8）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

（11）本基金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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

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

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

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

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

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

（17）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

（19）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

（21）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；

（22）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

（23）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

如果法律法规对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。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除第（9）、（17）、（20）、（21）条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调

整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

七、 标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证国有企业改革指数。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

若出现指数更名等对基金投资无实质性影响的标的指数变更情形，则无需召

开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在规定媒介上公告。

2、标的指数编制方案及查询途径

中证国有企业改革指数从沪深市场选取全部发生及拟发生改革的国有企业上市公司证券作为待选样本，其中已出台相关股权激励方案和重大资产重组方案的国企上市公司优先入选，以反映国企改革主题上市公司证券的整体表现。

（1）指数名称和代码

指数名称：中证国有企业改革指数

指数简称：国企改革

英文名称：CSI State-Owned Enterprises Reform Index

英文简称：CSI SOEs Reform

指数代码：399974

（2）指数基日和基点

该指数以 2014 年 3 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

（3）样本选取方法

1) 样本空间

同中证全指指数的样本空间。

2) 选样方法

a) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

b) 对样本空间内剩余证券，将全部发生及拟发生改革的国有企业公司作为待选样本；其中已出台相关股权激励方案、重大资产重组方案等的国企上市公司优先入选；

c) 在待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取不超过 100 只证券作为指数样本。

（4）指数计算

指数计算公式为：

报告期指数=报告期样本股的调整市值/除数×1000

其中，调整市值= \sum (证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的

计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 3%。

（5）指数样本和权重调整

1) 定期调整

指数样本每季度调整一次，样本调整实施时间分别为每年 3 月、6 月、9 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

2) 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

（6）有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：<http://www.csindex.com.cn>。

3、业绩比较基准

$95\% \times \text{中证国有企业改革指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$

由于本基金投资标的指数为中证国有企业改革指数，且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 $95\% \times \text{中证国有企业改革指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行对应适当程序，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上刊登公告。

八、 风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。

九、 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十、基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、投资组合报告

(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	5,263,974,363.67	93.66
	其中: 股票	5,263,974,363.67	93.66
2	固定收益投资	—	—
	其中: 债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	354,283,563.87	6.30
7	其他资产	1,829,184.15	0.03
8	合计	5,620,087,111.69	100.00

(二) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,778,498.21	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	19,147.31	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,848,511.86	0.07
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	17,552.98	0.00
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	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	5,663,710.36	0.10

（三）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	80,690,987.20	1.44
C	制造业	2,637,247,264.84	47.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	229,063,072.84	4.09
E	建筑业	277,725,099.02	4.95
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	150,451,927.84	2.68
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	259,869,583.99	4.63
J	金融业	1,072,424,246.48	19.13
K	房地产业	379,333,750.10	6.76

L	租赁和商务服务业	96,104,736.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	75,399,985.00	1.34
S	综合	—	—
	合计	5,258,310,653.31	93.78

（四）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	9,965,356.00	172,301,005.24	3.07
2	600030	中信证券	7,667,700.00	169,916,232.00	3.03
3	600036	招商银行	5,095,226.00	164,473,895.28	2.93
4	601398	工商银行	31,623,600.00	162,861,540.00	2.90
5	601668	中国建筑	30,835,300.00	162,502,031.00	2.90
6	600585	海螺水泥	2,938,204.00	161,895,040.40	2.89
7	601166	兴业银行	10,020,893.00	159,432,407.63	2.84
8	000858	五粮液	1,376,419.00	158,563,468.80	2.83
9	600048	保利地产	10,517,505.00	156,395,299.35	2.79
10	000651	格力电器	2,932,895.00	153,097,119.00	2.73

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

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	688111	金山办公	14,659.00	3,095,394.44	0.06
2	688200	华峰测控	3,780.00	558,948.60	0.01
3	688023	安恒信息	2,728.00	503,152.32	0.01
4	688233	神工股份	11,858.00	435,307.18	0.01
5	688258	卓易信息	3,465.00	249,965.10	0.00

(五) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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序的前五名债券投资明细

注：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序的前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

（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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：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、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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	387,487.72
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	72,361.13
5	应收申购款	1,369,335.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,829,184.15

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	688111	金山办公	3,095,394.44	0.06	科创板限售
2	688200	华峰测控	558,948.60	0.01	科创板限售
3	688023	安恒信息	503,152.32	0.01	科创板限售
4	688233	神工股份	435,307.18	0.01	科创板限售
5	688258	卓易信息	249,965.10	0.00	科创板限售

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

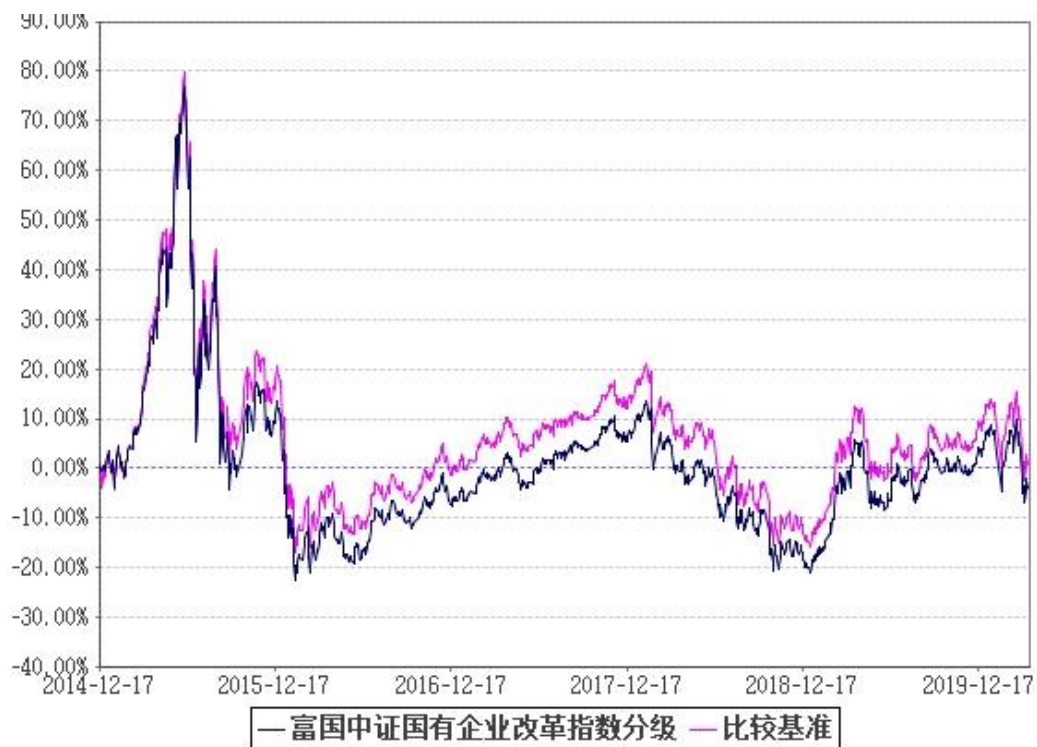
第十二部分 基金的业绩

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

一、 本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
2014.12.17-2014.12.31	0.60%	0.55%	-0.33%	1.60%	0.93%	-1.05%
2015.01.01-2015.12.31	9.66%	2.65%	17.20%	2.70%	-7.54%	-0.05%
2016.01.01-2016.12.31	-15.35%	1.70%	-14.83%	1.68%	-0.52%	0.02%
2017.01.01-2017.12.31	14.66%	0.66%	14.69%	0.65%	-0.03%	0.01%
2018.01.01-2018.12.31	-24.39%	1.28%	-25.20%	1.30%	0.81%	-0.02%
2019.01.01-2019.12.31	32.14%	1.20%	30.05%	1.19%	2.09%	0.01%
2020.01.01-2020.03.31	-9.40%	1.93%	-9.46%	1.93%	0.06%	0.00%
2014.12.17-2020.03.31	-4.25%	1.64%	0.51%	1.66%	-4.76%	-0.02%

二、 自基金合同生效以来基金累计份额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



注：1、截止日期为2020年3月31日。

2、本基金于2014年12月17日成立，建仓期6个月，从2014年12月17日起至2015年6月16日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

第十三部分 基金的财产

一、 基金资产总值

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

二、 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

三、 基金财产的账户

本基金财产以本基金名义开立资金账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户，并根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立期货账户及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、 基金财产的处分

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

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

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

第十四部分 基金资产的估值

一、 估值日

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

二、 估值方法

1、 证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

2、 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌

的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

8、当本基金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。

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

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

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

基金管理人对外公布基金净值信息的计算结果对外予以公布。

三、 估值对象

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

四、 估值程序

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

五、 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、 估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、 估值错误处理原则

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

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，

并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对差错负责。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”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

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

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，

由基金注册登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的原则和方法如下：

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

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

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

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、 基金净值的确认

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

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券/期货交易所、登记结算公司或标的指数供应商发送的数据错误，

有关会计制度变化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而造成的基金资产净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

第十五部分 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，基金管理人可进行收益分配；
- 2、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方

法，依照《业务规则》执行。

第十六部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产划拨支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的开户费用；
- 9、基金上市费用；
- 10、基金的指数使用许可费；
- 11、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。如上述指数许可使用协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在规定媒介进行公告。指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元。指数使用许可费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

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

本基金由富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金变更而来，基金变更前的相关费用按照当时有效的《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》执行。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”相应部分。

2、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”相应部分。

三、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

四、基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在规定媒介上刊登公告。

第十七部分 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会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

二、 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通知基金托管人。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

第十八部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。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及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

本基金公开披露的信息应采用中文文本。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。

公开披露的基金信息包括：

一、 招募说明书

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规定网站上；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。

二、 基金合同、托管协议、基金产品资料概要

基金变更后，基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

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，并登载在规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。

三、 《上市交易公告书》

基金管理人应当在基金管理人应当在本基金的基金份额上市交易 3 个工作日前，将《上市交易公告书》登载在规定媒介上。

四、 基金净值信息

在本基金上市交易或者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，通过规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

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

五、 基金份额申购、赎回价格公告

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

六、 基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1、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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计；

2、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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上；

3、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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上；

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

5、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

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上：

- 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；
- 8、基金募集期延长；
- 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 50%，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 30%；

11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、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、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

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、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

21、基金推出新业务或服务；

22、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、本基金上市交易、停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；

25、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或基金合同规定的其他事项。

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、基金上市交易的证券交易所。

九、 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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

十、 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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

十一、 投资于股指期货的信息

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

十二、 本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

十三、 中国证监会规定的其他信息

十四、 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、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

十五、 暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- （1）不可抗力；
- （2）发生基金合同约定的暂停估值的情形；
- （3）法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

十六、 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、基金托管人应当在规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规定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

十七、 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第十九部分 风险揭示

从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

一、投资于本基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

（2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。因此基金投资收益水平会受到利率变化的影响。

（4）购买力风险

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

2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

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

4、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投

资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

5、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。

在本基金交易过程中，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。

6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在本基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、注册登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等等。

8、合规性风险

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

9、基金估值风险

指每日基金估值可能发生错误的风险。

10、本基金的特定风险

（1）指数投资风险

1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整

个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2) 标的指数波动的风险

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

3) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

①基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

②若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

③在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的现金，由此基金管理人可能采取暂停赎回等流动性风险控制措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

③成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生跟踪误差。

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

⑤由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪误差。

⑥其他因素产生的跟踪误差。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动。

5) 标的指数变更的风险

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

6) 指数编制机构停止服务的风险

本基金标的指数的编制机构为中证指数有限公司，标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护。

如指数编制机构停止服务，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并，或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（2）基金运作的特有风险

在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。本基金在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

（3）科创板股票投资风险

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

基金投资科创板上市交易股票将承担科创板因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险，具体包括以下风险：

1) 公司治理风险。科创板股票发行实行注册制，上市条件与主板不同，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，可能存在表决权差异安排。

2) 流动性风险。由于参与科创板投资有一定的门槛要求，科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险。

3) 集中投资风险。科创板将集中以成长性的科技创新企业为主。由于投入规模大、技术迭代快、盈利周期长等行业特点，科创板企业的收入及盈利水平具有较大不确定性，可能存在公开发发行时和上市后仍无法盈利的情形。

4) 退市风险。科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格：

a) 退市情形更多。当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形，将直接导致退市；

b) 退市时间更短。因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序，因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形；

c) 执行标准更严。当上市公司明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入时，可能会直接导致退市。

5) 股价波动风险。科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%。

6) 集中度风险。科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

7) 系统性风险。科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

8) 政策风险。国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板

企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板企业也会带来政策影响。

11、基金投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

（1）与存托凭证相关的风险

1) 存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

2) 本基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，本基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

3) 本基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；本基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对本基金生效。本基金可能无法对此行使表决权。

5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，本基金可能存在失去应有权利的风险。

6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

7) 存托凭证退市的，本基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，本基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为本基金提供相应服务等风险。

（2）与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高

于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

（3）与境外发行人相关的风险

1) 红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

2) 红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

3) 红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

（4）与交易机制相关的风险

1) 境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

2) 红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

3) 在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

4) 本基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；本基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

12、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比

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

二、 声明

- 1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自主投资于本基金，须自行承担投资风险。
- 2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金销售机构公开销售，基金管理人与基金销售机构都不保证其收益或本金安全。

第二十部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

一、基金合同的变更

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

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自生效之日起2日内在规定媒介公告。

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、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、基金合同约定的其他情形；
- 5、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、基金财产清算组

(1) 基金合同终止情形发生时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2、基金财产清算程序

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

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

3、清算费用

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

4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的期限为6个月。

6、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。

7、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止情形发生并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财

产清算结果经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

8、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。

第二十一部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利、义务

(1) 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

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

3) 销售基金份额；

4) 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；

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

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

7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

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

10) 选择、更换销售机构，对其行为进行监督和检查；

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

12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13) 依法召集基金份额持有人大会；

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

15) 依法募集资金；

16) 依据基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

17) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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

2) 办理基金备案手续；

3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额净值和申购赎回价格；

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

10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

他人泄露；

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

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

17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

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

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

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

21) 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，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

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

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

24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

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

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

28) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

2. 基金托管人的权利

(1) 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

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

2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

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

6) 依法提议召开或召集基金份额持有人大会；

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

8) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

3) 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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定

外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

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

9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

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

11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及申购赎回价格；

13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

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

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

19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23) 建立并保存基金份额持有人名册；

24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利和义务

基金份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定拥有同等的权益。

（1）根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让其持有的本基金上市交易份额，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或者召集基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

（2）根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- 7) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- 8) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- 9) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 10) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

4、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

二、 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人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每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。

2、 召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 终止基金份额的上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- 10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

（2）在不违背法律法规和基金合同约定，以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适

用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；

- 5) 基金推出新业务或服务；
- 6) 基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 7) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 8) 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；
- 9) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、召集人和召集方式

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

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

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

(4) 单独或合计持有基金总份额 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，

单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

表决结果。

5、基金份额持有人出席会议的方式

（1）会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

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

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非书面方式由基金份额持有人对其代表进行授权；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

5) 会议的召开方式由召集人确定。

（2）召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

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

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

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

6、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容，以及法律法规和基金合同规定的其他事项及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 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% 以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

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

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

（2）议事程序

1) 现场开会

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

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额二分之一以上（含二分之一）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

2) 通讯方式开会

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

成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议

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

2) 特别决议

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

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

8、计票

(1) 现场开会

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

会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

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) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

9、基金份额持有人大会决议的生效和公告

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在规定媒介公告。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。

10. 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内

容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、 基金合同的变更

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

（2）关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自生效之日起2日内在规定媒介公告。

2、 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

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

3、 基金财产的清算

（1） 基金财产清算组

1) 基金合同终止情形发生时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

（2） 基金财产清算程序

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

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

（3）清算费用

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

（4）基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款 1) — 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的期限为 6 个月。

（6）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。

（7）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止情形发生并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财

产清算结果经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

（8）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、 争议解决方式

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

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

本基金合同受中国法律管辖。

五、 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

第二十二部分 基金托管协议的内容摘要

一、 托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

成立时间：1999 年 4 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】11 号

注册资本：人民币 5.2 亿元

组织形式：有限责任公司

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

存续期间：持续经营

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：赵瑛

（二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字【1998】23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证国有企业改革指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货

合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

（1）本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证国有企业改革指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

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

（4）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

（8）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

（11）本基金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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

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

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

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

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

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

（17）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

（19）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

（21）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；

(22) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除第（9）、（17）、（20）、（21）条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规对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。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人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。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托

管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择存款银行。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

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

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

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

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

(3) 在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4) 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

(5) 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。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。

(6) 基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

(7) 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法

承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

8、基金管理人应在基金首次投资中期票据前，与基金托管人签署相应的风险控制补充协议，并按照法律法规的规定和补充协议的约定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中期票据的投资管理制度。

9、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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。

10、基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

三、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

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

理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

四、基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户。

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

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，

基金托管人对此不承担任何责任。

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

2、基金资金账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

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

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

(4) 基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

3、基金证券账户的开立和管理

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

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

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

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

(5) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规

定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

4、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

5、其他账户的开立和管理

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

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

6、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

五、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。本基金分别计算基金份额净值。基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

六、 基金份额持有人名册的登记与保管

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

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

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

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

七、 争议解决方式

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

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

八、 托管协议的修改与终止

1、 托管协议的变更程序

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

2、 基金托管协议终止的情形

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

第二十三部分 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。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、 基金份额持有人交易资料服务

投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后，可通过销售网点查询和打印交易确认单。基金管理人将根据持有人账单订制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人定期或不定期发送对账单。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

二、 网上交易、查询服务

投资者除可通过基金管理人的直销网点和代销机构的代销网点办理申购、赎回等交易以及账户查询外，还可通过基金管理人的网站(www.fullgoal.com.cn)、微信公众号(搜索“富国基金微管家”或“FullgoalWeFund”)或客户端“富国富钱包”APP 享受网上交易、查询服务。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

三、 信息定制及资讯服务

投资者可通过拨打客服热线、在线客服、发送邮件、短信或登陆基金管理人网站等多种渠道，定制对账单、基金交易确认信息、周刊等各类资讯服务。当投资者接收定制服务的手机号码、电子邮箱、邮寄地址等信息不详、填写有误或发生变更时，可通过以上渠道更新修改，以避免无法及时接收相关定制服务。

四、 网络在线服务

投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、信息定制、服务投诉及建议等多项在线服务。

五、 客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工坐席提供每周 5 天、每天不少于 8 小时的座席服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等

专项服务，节假日除外。

六、 客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金公司网站投诉栏目、客户服务中心人工热线、在线客服、微客服、书信、电子邮件、短信、传真等多渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及公司的政策规定提出投诉或意见。

七、 基金管理人客户服务联络方式

客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费），工作时间内可转人工坐席。

客户服务传真：021-20513277

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

电子信箱：public@fullgoal.com.cn

客服中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

八、 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务中心热线，或通过电子邮件、传真、信件等方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十四部分 其他应披露事项

序号	公告日期	公告事项	信息披露方式
1	2019年6月19日	富国基金管理有限公司关于不法分子冒用我司名义的澄清公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
2	2019年6月21日	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
3	2019年6月26日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金暂停场内大额申购业务的公告	中国证券报
4	2019年6月26日	富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的中科曙光股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报
5	2019年7月1日	富国基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日基金资产净值和基金份额净值公告	公司官网
6	2019年8月1日	富国基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
7	2019年9月24日	富国基金管理有限公司关于住所变更的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报
8	2019年11月27日	富国基金管理有限公司关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金投资关联方证券的公告	中国证券报
9	2019年12月	关于富国中证国有企业改革指数分级证	中国证券报

序号	公告日期	公告事项	信息披露方式
	月 10 日	券投资基金办理定期份额折算业务的公告	
10	2019 年 12 月 10 日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报
11	2019 年 12 月 13 日	关于防范不法分子冒用富国基金名义进行非法活动的重要提示	公司官网
12	2019 年 12 月 16 日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间富国国企改革 A 份额停复牌的公告	中国证券报
13	2019 年 12 月 17 日	关于富国国企改革 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证券报
14	2019 年 12 月 17 日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报
15	2019 年 12 月 17 日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之富国国企改革 A 份额约定年基准收益率调整的公告	中国证券报
16	2019 年 12 月 24 日	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2019 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报
17	2019 年 12 月 24 日	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金 2020 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报
18	2020 年 1 月 20 日	富国基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下公募基金基金合同的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报

序号	公告日期	公告事项	信息披露方式
19	2020 年 2 月 3 日	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报
20	2020 年 3 月 14 日	关于富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告	中国证券报

第二十五部分 招募说明书存放及其查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

第二十六部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金募集的文件

（二）《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》

（三）《富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》

（四）《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金基金合同》

（五）《富国中证国有企业改革指数型证券投资基金托管协议》

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

（八）关于申请募集注册富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金之法律意见书

（九）注册登记协议

（十）中国证监会要求的其他文件

富国基金管理有限公司

2021年3月30日