

# 华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数 证券投资基金招募说明书（更新）

2021 年临时更新

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2021年1月25日证监许可【2021】210号文注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“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投资价值及市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险。

本基金的标的指数为中证沪港深500指数，指数编制方法如下：

(1) 样本空间：沪股通、深股通和港股通范围内的证券。

(2) 选样方法：

1) 对于样本空间内的沪深市场证券，按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的证券；对于样本空间内的香港市场证券，剔除过去一年日均成交金额不足3000万港元的证券；

2) 对于上述剩余待选证券，按照过去一年证券日均总市值从高到低排名，选取排名较高的500只证券成指数样本。

(3) 指数采用调整市值加权，并设置权重因子。权重因子介于0和1之间，以使单个样本权重不超过10%。

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：[www.csindex.com.cn](http://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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。同时由于本基金是跟踪中证沪港深500指数的交易型开放式指数基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数编制的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、成份股停牌的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、退补现金替代方式的风险、申购赎回清单标识设置风险、二级市场流动性风险、第三方机构

服务的风险、投资资产支持证券的风险、投资股指期货的风险、参与融资和转融通证券出借业务的风险、科创板股票投资风险、港股通标的股票投资风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、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、其他风险等等。

本基金被动跟踪标的指数“中证沪港深500指数”，主要采用组合复制策略，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。因此，本基金的业绩表现与中证沪港深500指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其预期风险和预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分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，基金资产并非必然投资科创板股票。本基金资产投资于科创板股票时，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

在目前的业务规则下，投资者投资本基金时需具有上海证券交易所A股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证沪港深500指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用中证沪港深500指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

本基金以人民币募集和计价，本基金可通过港股通投资于香港市场以港币计价的金融工具，人民币对港币的汇率的波动可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生一定影响。

本基金可投资股指期货，可能面临杠杆风险、基差风险、股指期货展期时的流动性风险、期货盯市结算制度带来的现金管理风险、到期日风险、对手方风险、连带风险、未平仓合约不能继续持有风险等。

本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。本基金可参与转融通证券出借业务。转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存

托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及《基金合同》等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，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。

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也不构成对本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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金管理人于2021年3月31日发布的《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引〉、〈存托凭证发行与交易管理办法（试行）〉修改基金合同部分条款的公告》进行更新，前述修订内容自2021年3月31日起生效。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的，以本次更新的招募说明书为准。

目 录

一、绪言.....	6
二、释义.....	7
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	21
六、基金的募集.....	23
七、基金备案.....	29
八、基金份额折算与变更登记.....	30
九、基金份额的上市交易.....	31
十、基金份额的申购与赎回.....	33
十一、基金的投资.....	56
十二、基金的财产.....	62
十三、基金资产估值.....	63
十四、基金的收益分配.....	68
十五、基金的费用与税收.....	69
十六、基金的会计与审计.....	71
十七、基金的信息披露.....	72
十八、风险揭示.....	78
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	87
二十、基金合同的内容摘要.....	89
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	102
二十二、对基金份额持有人的服务.....	110
二十三、其他应披露事项.....	111
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	112
二十五、备查文件.....	113

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《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》”)、其他有关规定及《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数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,投资者在作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、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。

本基金是根据本招募说明书所载明资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人士提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指华宝基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、上市交易公告书：指《华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》
- 10、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
- 11、《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
- 12、《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
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，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
- 14、《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
- 15、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 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

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

18、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

21、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

22、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

23、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法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

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

25、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

27、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》所定义的机构投资者

28、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

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

30、销售机构：指直销机构及代销机构

31、直销机构：指华宝基金管理有限公司

32、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

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

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



35、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

36、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（及其不时修订）规定的基金登记、存管、结算及相关业务

37、登记机构：指办理登记业务的机构。基金管理人可自行或委托其他机构代为办理登记业务。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

38、上海证券账户：指上海证券交易所人民币普通股股票账户（即 A 股账户）或上海证券交易所基金账户

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

40、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

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

42、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

43、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

44、T 日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日

45、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

46、开放日：指上海证券交易所、深圳证券交易所和港股通的共同交易日，基金管理人在开放日为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务

47、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

48、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》、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关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所发布的其他相关规则 and 规定

49、认购：指在基金募集期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

50、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，以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人申请购买基金份额的行为

51、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申购赎回清单规定的赎回对价的行为

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

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

54、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应

交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

55、标的指数：指中证沪港深 500 指数，及其未来可能发生的变更

56、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

57、最小申购赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

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

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

60、元：指人民币元

61、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

62、收益评价日：指基金管理人计算本基金份额净值增长率与标的指数同期增长率差额之日

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

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

65、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

66、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

67、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

68、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

69、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

70、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

71、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

72、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

73、港股通：指投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所/深圳证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

总经理：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49% 的股份。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

朱永红先生，董事长，博士。曾任武汉钢铁（集团）公司战略研究室主任、财务总监兼计划财务部部长、副总会计师、总会计师等职务。现任华宝基金管理有限公司董事长，中国宝武钢铁集团有限公司党委常委、总会计师兼董事会秘书，宝山钢铁股份有限公司监事会主席，中国太平洋保险（集团）股份有限公司监事会主席，宝武集团财务有限责任公司董事长。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

魏臻先生，董事。曾任麦肯锡（上海）咨询公司分析师，摩根斯坦利亚洲公司分析师，香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务股份有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研

研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司执行董事兼总经理，大成食品（亚洲）有限公司执行董事、董事会主席、执行委员会主席。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

## 2、监事会成员

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

黄洪永先生，监事，硕士。曾任宝钢集团规划部、管理创新部综合主管，宝钢工程党委组织部、人力资源部部长，广东钢铁集团规划部副部长，广东宝钢置业副总经理，宝钢集团人事效率总监、领导力发展总监，中国宝武集团领导力发展总监，中国宝武钢铁集团产业金融党工委副书记、纪工委书记；现任华宝投资有限公司党委副书记、纪委书记。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司互金业务总监兼互金策划部总经理。

江滨女士，监事，硕士。曾任华宝基金管理有限公司法务经理，高级法务经理，监察稽核部副总经理、总经理。现任华宝基金管理有限公司助理总监兼合规审计部总经理。

## 3、高级管理人员

朱永红先生，董事长，简历同上。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）女士，总经理，简历同上。

刘欣先生，常务副总经理，本科。曾任中国国际金融有限公司投资银行部分析师、经理，美林（亚太）有限公司投资银行部经理、亚洲企业融资部副总裁/董事，瑞士信贷香港有限公司投资银行部副总裁，北京春雨天下软件有限公司首席财务官，亚投顾问有限公司高级顾问等职务。现任华宝基金管理有限公司常务副总经理。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生，副总经理，硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

周雷先生，督察长，硕士。曾任职于中国机械设备进出口总公司、北京证监局、中国证监会，曾任华宝证券有限责任公司首席风险官、合规总监。现任华宝基金管理有限公司督察长。

李孟恒先生，首席信息官，硕士。曾在 T.A. Consultanted LTD. 从事开发及技术管理

工作。2002 年参与华宝基金管理有限公司筹备工作，后历任信息技术部资深系统工程师、部门副总经理，营运副总监兼信息技术部总经理，现任华宝基金管理有限公司首席信息官。

#### 4、本基金拟任基金经理

蒋俊阳，硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作，2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，担任基金经理助理职务。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

#### 5、指数投资决策委员会

XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）女士，公司总经理。

胡洁女士，指数研发投资部总经理，华宝中证医疗指数证券投资基金基金经理、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金经理、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金（LOF）基金经理、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金（LOF）基金经理、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金经理。

蒋俊阳先生，华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

陈建华先生，华宝中证 100 指数型证券投资基金基金经理。

徐林明先生，投资副总监、量化投资部总经理，华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理、华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监，华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

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

2、办理本基金备案手续；

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、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）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、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （五）基金管理人内部控制制度

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、操作风

险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）等。

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）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（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并将风险归类。

（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、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了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进行实时监控，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（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及时而有效地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）内部风险控制原则

合规性原则。内部控制机制应符合法律和监管要求，规范和促使公司经营管理及公司员工执业行为符合法律法规、行业规范和自律规则，以及行业普遍遵守的职业道德和行为。

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司自有资产、各项受托资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉未公开信息或涉及多部门信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。



成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变，及时修改或完善。

实效性原则。内部控制制度应得到有效执行。公司应当树立和强化管理制度化、制度流程化、流程信息化的内控理念，通过强监管、严问责、加强信息化管理，严格落实各项规章制度。

#### （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完善的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、合规和法务管理控制、风险管理控制、审计稽核控制，及反洗钱控制等。

#### （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### （4）监察稽核及风险管理制度

合规审计部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

合规审计部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责

包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2020 年 6 月 30 日，中国银行已托管 830 只证券投资基金，其中境内基金 783 只，QDII 基金 47 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”

双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、网下现金发售和网下股票发售直销机构

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区浦电路 370 号宝钢大厦 905 室

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、021-50988055

网址：www.fsfund.com

#### 2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

#### 3、网上现金发售代理机构

投资人可直接通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：戴文华

联系人：朱立元

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

### （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：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

（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（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

法定代表人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：陈露

经办注册会计师：陈露、许培菁

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

准予注册文件：中国证监会证监许可【2021】210号

准予注册日期：2021年1月25日

### (一) 基金的类别、运作方式与存续期限

1、基金的类别：股票型证券投资基金

2、基金的运作方式：交易型开放式

3、基金存续期限：不定期

### (二) 募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

### (三) 募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

### (四) 募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。

投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

### (五) 基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元，认购价格为1.00元。

### (六) 基金开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户。

1、如投资者需新开立上海证券账户，则应注意：

(1) 上海证券交易所基金账户只能进行现金认购和二级市场交易；如投资者需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票进行网下股票认购或者进行基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则应同时开立上海证券账户和深圳证券交易所A股账户。

(2) 开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2、如投资者已开立上海证券账户，则应注意：

(1) 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购的1个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

#### (七) 认购费用

本基金的认购费用由投资者承担，认购费率如下图表所示：

认购份额（份）	认购费率
小于 50 万	0.8%
大于等于 50 万，小于 100 万	0.5%
100 万（含）以上	每笔 1000 元

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、登记结算费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

#### (八) 网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。



例：某投资者通过网上现金认购1,000份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 1,000 \times 0.8\% = 8 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.8\%) = 1,008 \text{元}$$

即投资者需准备1,008元资金，可认购到1,000份本基金基金份额。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者应以上海证券账户认购，可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

#### (九) 网下现金认购

1、认购时间详见基金份额发售公告。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

$$(\text{或若适用固定费用的, 认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} + \text{固定费用})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

$$(\text{或若适用固定费用的, 认购费用} = \text{固定费用})$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。

例：某投资者到基金管理人直销网点认购100,000份基金份额，认购费率为0.8%，假定认购金额产生的利息为10元，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.8\% = 800 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.8\%) = 100,800 \text{元}$$

$$\text{净认购份额} = 100,000 + 10 / 1.00 = 100,010 \text{份}$$

即投资人若通过基金管理人认购本基金100,000份，需准备100,800元资金，假定该笔认

购金额产生利息10元，则投资人可得到100,010份本基金基金份额。

3、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购，每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

5、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。认购一经确认不得撤销。

6、清算交收：T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于T+2日进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。现金认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

7、认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资人可通过其办理认购的销售机构或其他方式查询认购确认情况。

#### (十) 网下股票认购

1、认购时间详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以基金份额发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者应以A股账户认购，可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

#### 4、特殊情形

(1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常

或长期停牌的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

5、清算交收：网下股票认购最后一日，发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。基金募集期结束后，登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海市场和深圳市场的股票过户至本基金的证券账户。基金合同生效后，登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

6、认购份额的计算公式：

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量} / 1.00$$

其中，

(1)  $i$ 代表投资者提交认购申请的第 $i$ 只股票， $n$ 代表投资人提交的股票总只数。如投资者仅提交了1只股票的申请，则 $n=1$ 。

(2) “第 $i$ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整：

除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价 / (1+每股送股比例)

配股：调整后价格= (网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例) / (1+每股配股比例)

送股且配股：调整后价格= (网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例) / (1+每股送股比例+每股配股比例)

除息、送股且配股：调整后价格= (网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息) / (1+每股送股比例+每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中，

1) 对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

$$q^{\max} = (\text{Cash} + \sum_{j=1}^n p_j q_j) \times 105\% \times w / p$$

$q^{\max}$  为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量，Cash为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额， $p_j q_j$  为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积，w为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日标的指数中的权重（认购期间如有标的指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的标的指数构成权重，并以其作为计算依据），p为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

2) 若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

7、特别提示：投资者应根据法律法规及上海证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

#### （十一） 募集期间认购资金与股票

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户，最终将投资者申请认购的股票过户至基金证券账户。投资者的认购股票在募集冻结期间的权益归投资者所有。

## 七、基金备案

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购募集的股票由发售代理机构予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，发售代理机构应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。

### 一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算基准日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

### 二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（因尾数处理而产生的损益不视为实质性影响）。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

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

### 三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市

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

- 1、场内基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不低于2亿元；
- 2、场内基金份额持有人不少于1,000人；
- 3、上海证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

### （二）基金份额的上市交易

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

### （三）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易：

- 1、不再具备本部分第（一）条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起2日内发布基金终止上市公告。

若因上述1、4、5项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，届时基金管理人可变更本基金的登记机构、申购与赎回的安排等条款并根据变更为非上市指数基金的情况相应调整基金合同，而无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

### （四）基金份额参考净值的计算与公告

本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算，并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

- 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购、赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购赎回单位对应的基金份额。  
(港股最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格)。

汇率公允价包括中证指数有限公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格等。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后4位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

(五) 相关法律法规、中国证监会、登记机构及上海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，本基金按照新规定执行，由此对基金合同进行修订的，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

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

(七) 在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。



## 十、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

对于申购赎回的投资者，应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，在基金管理人网站公示。基金管理人在确定、变更申购赎回代理券商名单时，均应在公告之前报请上海证券交易所认可。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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、港股通交易规则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

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

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

### （三）申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，具体交付的申购对价以基金管理人不时公告的招募说明书及申购赎回清单的规定为准；
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整，或依据上海证券交易所或登记机构相关规则及其变更调整上述规则。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）申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资者在提交赎回申请时持有足够的基金份额余额和现金，则赎回申请成立，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申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

##### 2、申购和赎回申请的确认

正常情况下，基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请不成立。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售机构或其他方式查询确认情况。

申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。

投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销；在T+1日办理现金差额的清算；在T+2日办理现金差额的交收；在T+7日（指开放日）内办理现金替代的清算与交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。但如果出现港股通暂停交易或交收、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则款项的清算交收可延迟办理。

申购产生的港股通应退款项、赎回现金替代款交收日为港股通交收日。

如果相关证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变更，则按最新规则办理，详见届

时公告或招募说明书更新。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形,则依据《业务规则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

投资者应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额、现金替代或现金替代补款未能按时足额交收的,基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿,并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

登记机构可在法律法规允许的范围内,对申购赎回的程序、份额清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整,并提前公告。

#### (五) 申购和赎回的数量限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位为300万份。

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份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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定数量或比例限制。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。

基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限,并在申购赎回清单中公告。

#### (六) 申购、赎回的对价、费用

1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。

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

3、申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日证券交易所开市前公告。

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

基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

(七) 申购赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

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

2、组合证券相关内容

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

3、现金替代相关内容

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

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

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

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

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

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

(1) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。目前仅适用于标的指数中的上海证券交易所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如

果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将退还多收取的差额;如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

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

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

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

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

若现金替代日(T日)后至T+2日(若在特例情况下,则为T日起第20个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则进行相应调整。

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

④替代限制:为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为:

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

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

参考基金份额净值为本基金前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化,以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### (2) 必须现金替代

①适用情形:必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整,即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票;或因法律法规限制投资的成份证券;或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的

一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量、其调整后T日开盘参考价以及T-1日估值汇率（如需）的相乘之和或基金管理人认为合理的其他方法。

### （3）退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数中深圳证券交易所股票、香港联合交易所上市股票。

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

赎回的替代金额=替代证券数量×该证券调整后T日开盘参考价×T-1日估值汇率（如需）×（1-现金替代折价比例）。

如果上海证券交易所调整上述替代金额计算公式，以上海证券交易所通知规定的为准。

### ③替代金额的处理程序

#### 1) 深圳证券交易所退补现金替代

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

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

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

基金管理人将自T日起在收到申购交易确认后依次买入申购被替代的部分证券。T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资人或申购投资人应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照T+2日收盘价（被替代组合证券当日无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资人或申购投资

人应补交的款项。

基金管理人将自T日起在收到赎回交易确认后依次卖出赎回被替代的部分证券。T+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资人或赎回投资人应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照T+2日收盘价（被替代组合证券当日无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资人或赎回投资人应补交的款项。

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

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

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

正常情况下，T+7日（指开放日）内基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，并进行相关款项的清算交收。

## 2) 香港联合交易所退补现金替代

申购替代金额的处理程序：在T日（指港股通交易日）内，基金管理人以收到的替代金额代投资者买入被替代证券。T日（指港股通交易日）日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用）和未买入的被替代证券的T日（指港股通交易日）收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T日（指港股通交易日）在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。T日（指港股通交易日）后的第2个港股通交收日的三个工作日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理券商办理交收。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。出现半日港股通交易日、因为风球等因素引发临时停市或港股通每日额度不足等特殊情况时，计算并确定被替代证券的单位结算成本的时间可顺延，款项交收的日期也可顺延。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照

证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护基金份额持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

赎回替代金额的处理程序：在 T 日（指港股通交易日）内，基金管理人以收到的替代金额代投资者卖出被替代证券。T 日（指港股通交易日）日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的 T 日（指港股通交易日）收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；被替代证券 T 日（指港股通交易日）在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。T 日（指港股通交易日）后的第 2 个港股通交收日后的 3 个工作日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理机构办理交收。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。当出现半日港股通交易日、因为风球等因素引发临时停市或港股通每日额度不足等特殊情况时，计算并确定被替代证券的单位结算成本的时间可顺延，款项交收的日期也可顺延。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护基金份额持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

#### （4）特殊情况

1) 申购产生的港股通应退款项、赎回现金替代款交收日为港股通交收日，若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。

2) 如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

3) 未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或上海证券交易所、登记机构 ETF 申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。

#### 4、预估现金部分相关内容

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



T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

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

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

#### 5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

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

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

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

#### 6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下

基本信息

最新公告日期	2021-2-2
基金名称	华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华宝基金管理有限公司
一级市场基金代码	517061

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	1234.00
------------	---------

最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	3000000.00
基金份额净值（单位：元）	1.0000

T 日信息内容

当日累计申购上限	无
当日累计赎回上限	无
预估现金部分（单位：元）	1234.00
现金替代比例上限	50%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	3,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量 (股)	现金替代 标志	申购现 金替代 溢价比 率	赎回 现金 替代 折价 比率	替代金额(单 位：人民币元)
600000.SH	浦发银行	400	允许	10%	0%	
600004.SH	白云机场	100	允许	10%	0%	
600009.SH	上海机场	100	允许	10%	0%	
600010.SH	包钢股份	700	允许	10%	0%	
600011.SH	华能国际	200	允许	10%	0%	
600015.SH	华夏银行	200	允许	10%	0%	
600016.SH	民生银行	700	允许	10%	0%	
600018.SH	上港集团	100	允许	10%	0%	
600019.SH	宝钢股份	300	允许	10%	0%	
600025.SH	华能水电	100	允许	10%	0%	
600027.SH	华电国际	100	允许	10%	0%	
600028.SH	中国石化	400	允许	10%	0%	
600029.SH	南方航空	100	允许	10%	0%	
600030.SH	中信证券	300	允许	10%	0%	
600031.SH	三一重工	200	允许	10%	0%	
600036.SH	招商银行	400	允许	10%	0%	
600038.SH	中直股份	100	允许	10%	0%	
600048.SH	保利地产	200	允许	10%	0%	
600050.SH	中国联通	300	允许	10%	0%	
600061.SH	国投资本	100	允许	10%	0%	
600066.SH	宇通客车	100	允许	10%	0%	
600068.SH	葛洲坝	100	允许	10%	0%	
600089.SH	特变电工	100	允许	10%	0%	
600104.SH	上汽集团	100	允许	10%	0%	
600109.SH	国金证券	100	允许	10%	0%	

600111.SH	北方稀土	100	允许	10%	0%	
600115.SH	东方航空	100	允许	10%	0%	
600118.SH	中国卫星	100	允许	10%	0%	
600150.SH	中国船舶	100	允许	10%	0%	
600153.SH	建发股份	100	允许	10%	0%	
600161.SH	天坛生物	100	允许	10%	0%	
600176.SH	中国巨石	100	允许	10%	0%	
600177.SH	雅戈尔	100	允许	10%	0%	
600183.SH	生益科技	100	允许	10%	0%	
600188.SH	兖州煤业	100	允许	10%	0%	
600196.SH	复星医药	100	允许	10%	0%	
600208.SH	新湖中宝	100	允许	10%	0%	
600219.SH	南山铝业	200	允许	10%	0%	
600233.SH	圆通速递	100	允许	10%	0%	
600276.SH	恒瑞医药	100	允许	10%	0%	
600298.SH	安琪酵母	100	允许	10%	0%	
600299.SH	安迪苏	100	允许	10%	0%	
600309.SH	万华化学	100	允许	10%	0%	
600332.SH	白云山	100	允许	10%	0%	
600340.SH	华夏幸福	100	允许	10%	0%	
600346.SH	恒力石化	100	允许	10%	0%	
600352.SH	浙江龙盛	100	允许	10%	0%	
600362.SH	江西铜业	100	允许	10%	0%	
600369.SH	西南证券	100	允许	10%	0%	
600372.SH	中航电子	100	允许	10%	0%	
600383.SH	金地集团	100	允许	10%	0%	
600406.SH	国电南瑞	100	允许	10%	0%	
600426.SH	华鲁恒升	100	允许	10%	0%	
600436.SH	片仔癀	100	允许	10%	0%	
600438.SH	通威股份	100	允许	10%	0%	
600487.SH	亨通光电	100	允许	10%	0%	
600489.SH	中金黄金	100	允许	10%	0%	
600498.SH	烽火通信	100	允许	10%	0%	
600516.SH	方大炭素	100	允许	10%	0%	
600519.SH	贵州茅台	100	允许	10%	0%	
600521.SH	华海药业	100	允许	10%	0%	
600522.SH	中天科技	100	允许	10%	0%	
600536.SH	中国软件	100	允许	10%	0%	
600547.SH	山东黄金	100	允许	10%	0%	
600570.SH	恒生电子	100	允许	10%	0%	
600583.SH	海油工程	100	允许	10%	0%	
600584.SH	长电科技	100	允许	10%	0%	
600585.SH	海螺水泥	100	允许	10%	0%	
600588.SH	用友网络	100	允许	10%	0%	
600600.SH	青岛啤酒	100	允许	10%	0%	
600606.SH	绿地控股	100	允许	10%	0%	
600637.SH	东方明珠	100	允许	10%	0%	
600660.SH	福耀玻璃	100	允许	10%	0%	
600690.SH	海尔智家	100	允许	10%	0%	

600699.SH	均胜电子	100	允许	10%	0%	
600703.SH	三安光电	100	允许	10%	0%	
600705.SH	中航资本	200	允许	10%	0%	
600741.SH	华域汽车	100	允许	10%	0%	
600745.SH	闻泰科技	100	允许	10%	0%	
600760.SH	中航沈飞	100	允许	10%	0%	
600763.SH	通策医疗	100	允许	10%	0%	
600801.SH	华新水泥	100	允许	10%	0%	
600809.SH	山西汾酒	100	允许	10%	0%	
600837.SH	海通证券	300	允许	10%	0%	
600845.SH	宝信软件	100	允许	10%	0%	
600848.SH	上海临港	100	允许	10%	0%	
600867.SH	通化东宝	100	允许	10%	0%	
600872.SH	中炬高新	100	允许	10%	0%	
600886.SH	国投电力	100	允许	10%	0%	
600887.SH	伊利股份	200	允许	10%	0%	
600893.SH	航发动力	100	允许	10%	0%	
600895.SH	张江高科	100	允许	10%	0%	
600900.SH	长江电力	300	允许	10%	0%	
600918.SH	中泰证券	100	允许	10%	0%	
600919.SH	江苏银行	400	允许	10%	0%	
600926.SH	杭州银行	100	允许	10%	0%	
600958.SH	东方证券	100	允许	10%	0%	
600977.SH	中国电影	100	允许	10%	0%	
600989.SH	宝丰能源	100	允许	10%	0%	
600999.SH	招商证券	100	允许	10%	0%	
601006.SH	大秦铁路	200	允许	10%	0%	
601009.SH	南京银行	200	允许	10%	0%	
601012.SH	隆基股份	100	允许	10%	0%	
601021.SH	春秋航空	100	允许	10%	0%	
601066.SH	中信建投	100	允许	10%	0%	
601077.SH	渝农商行	100	允许	10%	0%	
601088.SH	中国神华	100	允许	10%	0%	
601100.SH	恒立液压	100	允许	10%	0%	
601108.SH	财通证券	100	允许	10%	0%	
601111.SH	中国国航	100	允许	10%	0%	
601117.SH	中国化学	100	允许	10%	0%	
601138.SH	工业富联	100	允许	10%	0%	
601155.SH	新城控股	100	允许	10%	0%	
601162.SH	天风证券	100	允许	10%	0%	
601166.SH	兴业银行	400	允许	10%	0%	
601169.SH	北京银行	500	允许	10%	0%	
601186.SH	中国铁建	200	允许	10%	0%	
601198.SH	东兴证券	100	允许	10%	0%	
601211.SH	国泰君安	100	允许	10%	0%	
601216.SH	君正集团	100	允许	10%	0%	
601225.SH	陕西煤业	100	允许	10%	0%	
601229.SH	上海银行	300	允许	10%	0%	
601231.SH	环旭电子	100	允许	10%	0%	

601233.SH	桐昆股份	100	允许	10%	0%	
601236.SH	红塔证券	100	允许	10%	0%	
601238.SH	广汽集团	100	允许	10%	0%	
601288.SH	农业银行	1000	允许	10%	0%	
601318.SH	中国平安	400	允许	10%	0%	
601319.SH	中国人保	100	允许	10%	0%	
601328.SH	交通银行	900	允许	10%	0%	
601336.SH	新华保险	100	允许	10%	0%	
601360.SH	三六零	100	允许	10%	0%	
601377.SH	兴业证券	200	允许	10%	0%	
601390.SH	中国中铁	300	允许	10%	0%	
601398.SH	工商银行	1200	允许	10%	0%	
601456.SH	国联证券	100	允许	10%	0%	
601555.SH	东吴证券	100	允许	10%	0%	
601577.SH	长沙银行	100	允许	10%	0%	
601600.SH	中国铝业	200	允许	10%	0%	
601601.SH	中国太保	100	允许	10%	0%	
601607.SH	上海医药	100	允许	10%	0%	
601618.SH	中国中冶	200	允许	10%	0%	
601628.SH	中国人寿	100	允许	10%	0%	
601633.SH	长城汽车	100	允许	10%	0%	
601658.SH	邮储银行	100	允许	10%	0%	
601668.SH	中国建筑	700	允许	10%	0%	
601669.SH	中国电建	300	允许	10%	0%	
601688.SH	华泰证券	200	允许	10%	0%	
601696.SH	中银证券	100	允许	10%	0%	
601698.SH	中国卫通	100	允许	10%	0%	
601727.SH	上海电气	100	允许	10%	0%	
601766.SH	中国中车	400	允许	10%	0%	
601788.SH	光大证券	100	允许	10%	0%	
601800.SH	中国交建	100	允许	10%	0%	
601808.SH	中海油服	100	允许	10%	0%	
601816.SH	京沪高铁	100	允许	10%	0%	
601818.SH	光大银行	500	允许	10%	0%	
601838.SH	成都银行	100	允许	10%	0%	
601857.SH	中国石油	300	允许	10%	0%	
601872.SH	招商轮船	100	允许	10%	0%	
601877.SH	正泰电器	100	允许	10%	0%	
601878.SH	浙商证券	100	允许	10%	0%	
601881.SH	中国银河	100	允许	10%	0%	
601888.SH	中国中免	100	允许	10%	0%	
601899.SH	紫金矿业	400	允许	10%	0%	
601901.SH	方正证券	100	允许	10%	0%	
601916.SH	浙商银行	100	允许	10%	0%	
601919.SH	中远海控	200	允许	10%	0%	
601933.SH	永辉超市	100	允许	10%	0%	
601939.SH	建设银行	200	允许	10%	0%	
601985.SH	中国核电	200	允许	10%	0%	
601988.SH	中国银行	700	允许	10%	0%	

601989.SH	中国重工	300	允许	10%	0%	
601990.SH	南京证券	100	允许	10%	0%	
601992.SH	金隅集团	100	允许	10%	0%	
601998.SH	中信银行	100	允许	10%	0%	
603019.SH	中科曙光	100	允许	10%	0%	
603087.SH	甘李药业	100	允许	10%	0%	
603160.SH	汇顶科技	100	允许	10%	0%	
603195.SH	公牛集团	100	允许	10%	0%	
603233.SH	大参林	100	允许	10%	0%	
603259.SH	药明康德	100	允许	10%	0%	
603288.SH	海天味业	100	允许	10%	0%	
603338.SH	浙江鼎力	100	允许	10%	0%	
603369.SH	今世缘	100	允许	10%	0%	
603392.SH	万泰生物	100	允许	10%	0%	
603444.SH	吉比特	100	允许	10%	0%	
603501.SH	韦尔股份	100	允许	10%	0%	
603517.SH	绝味食品	100	允许	10%	0%	
603589.SH	口子窖	100	允许	10%	0%	
603658.SH	安图生物	100	允许	10%	0%	
603659.SH	璞泰来	100	允许	10%	0%	
603707.SH	健友股份	100	允许	10%	0%	
603799.SH	华友钴业	100	允许	10%	0%	
603806.SH	福斯特	100	允许	10%	0%	
603816.SH	顾家家居	100	允许	10%	0%	
603833.SH	欧派家居	100	允许	10%	0%	
603858.SH	步长制药	100	允许	10%	0%	
603866.SH	桃李面包	100	允许	10%	0%	
603882.SH	金域医学	100	允许	10%	0%	
603899.SH	晨光文具	100	允许	10%	0%	
603939.SH	益丰药房	100	允许	10%	0%	
603986.SH	兆易创新	100	允许	10%	0%	
603993.SH	洛阳钼业	200	允许	10%	0%	
0001.HK	长和	100	港市退补	10%	10%	5390
0002.HK	中电控股	100	港市退补	10%	10%	7220
0003.HK	香港中华煤气	300	港市退补	10%	10%	3288
0004.HK	九龙仓集团	100	港市退补	10%	10%	1706
0005.HK	汇丰控股	600	港市退补	10%	10%	24810
0006.HK	电能实业	100	港市退补	10%	10%	4155
0008.HK	电讯盈科	100	港市退补	10%	10%	446
0011.HK	恒生银行	100	港市退补	10%	10%	13980
0012.HK	恒基地产	100	港市退补	10%	10%	3125
0014.HK	希慎兴业	100	港市退补	10%	10%	2835
0016.HK	新鸿基地产	100	港市退补	10%	10%	10600
0017.HK	新世界发展	100	港市退补	10%	10%	3535
0019.HK	太古股份公司 A	100	港市退补	10%	10%	4845
0027.HK	银河娱乐	100	港市退补	10%	10%	6145
0066.HK	港铁公司	100	港市退补	10%	10%	4445
0083.HK	信和置业	100	港市退补	10%	10%	1112
0101.HK	恒隆地产	100	港市退补	10%	10%	1966

0135.HK	昆仑能源	100	港市退补	10%	10%	704
0144.HK	招商局港口	100	港市退补	10%	10%	1104
0151.HK	中国旺旺	200	港市退补	10%	10%	1114
0152.HK	深圳国际	100	港市退补	10%	10%	1304
0175.HK	吉利汽车	200	港市退补	10%	10%	5890
0241.HK	阿里健康	100	港市退补	10%	10%	2650
0257.HK	光大环境	100	港市退补	10%	10%	463
0267.HK	中信股份	200	港市退补	10%	10%	1216
0268.HK	金蝶国际	100	港市退补	10%	10%	3440
0270.HK	粤海投资	100	港市退补	10%	10%	1370
0285.HK	比亚迪电子	100	港市退补	10%	10%	5870
0288.HK	万洲国际	200	港市退补	10%	10%	1286
0291.HK	华润啤酒	100	港市退补	10%	10%	7250
0293.HK	国泰航空	100	港市退补	10%	10%	630
0322.HK	康师傅控股	100	港市退补	10%	10%	1510
0345.HK	VITASOY INT'L	100	港市退补	10%	10%	3385
0371.HK	北控水务集团	100	港市退补	10%	10%	315
0384.HK	中国燃气	100	港市退补	10%	10%	2860
0386.HK	中国石油化工股份	700	港市退补	10%	10%	2625
0388.HK	香港交易所	100	港市退补	10%	10%	52100
0392.HK	北京控股	100	港市退补	10%	10%	2590
0425.HK	敏实集团	100	港市退补	10%	10%	3740
0522.HK	ASM PACIFIC	100	港市退补	10%	10%	11660
0586.HK	海螺创业	100	港市退补	10%	10%	3670
0656.HK	复星国际	100	港市退补	10%	10%	1192
0659.HK	新创建集团	100	港市退补	10%	10%	755
0669.HK	创科实业	100	港市退补	10%	10%	11680
0683.HK	嘉里建设	100	港市退补	10%	10%	2040
0688.HK	中国海外发展	100	港市退补	10%	10%	1778
0700.HK	腾讯控股	200	港市退补	10%	10%	147200
0728.HK	中国电信	400	港市退补	10%	10%	924
0753.HK	中国国航	100	港市退补	10%	10%	554
0762.HK	中国联通	200	港市退补	10%	10%	892
0772.HK	阅文集团	100	港市退补	10%	10%	7755
0780.HK	同程艺龙	100	港市退补	10%	10%	1470
0788.HK	中国铁塔	1300	港市退补	10%	10%	1482
0813.HK	世茂集团	100	港市退补	10%	10%	2225
0817.HK	中国金茂	200	港市退补	10%	10%	644
0836.HK	华润电力	100	港市退补	10%	10%	817
0853.HK	微创医疗	100	港市退补	10%	10%	5520
0857.HK	中国石油股份	600	港市退补	10%	10%	1422
0868.HK	信义玻璃	100	港市退补	10%	10%	1962
0880.HK	澳博控股	100	港市退补	10%	10%	867
0881.HK	中升控股	100	港市退补	10%	10%	5065
0883.HK	中国海洋石油	400	港市退补	10%	10%	3384
0884.HK	旭辉控股集团	100	港市退补	10%	10%	670
0909.HK	明源云集团控股	100	港市退补	10%	10%	5100
0914.HK	海螺水泥	100	港市退补	10%	10%	4620

0939.HK	建设银行	3300	港市退补	10%	10%	19371
0941.HK	中国移动	200	港市退补	10%	10%	9650
0960.HK	龙湖集团	100	港市退补	10%	10%	4150
0966.HK	中国太平	100	港市退补	10%	10%	1426
0968.HK	信义光能	100	港市退补	10%	10%	1860
0981.HK	中芯国际	100	港市退补	10%	10%	2795
0992.HK	联想集团	200	港市退补	10%	10%	2032
0998.HK	中信银行	300	港市退补	10%	10%	1056
1030.HK	新城发展	100	港市退补	10%	10%	732
1038.HK	长江基建集团	100	港市退补	10%	10%	4170
1044.HK	恒安国际	100	港市退补	10%	10%	5405
1060.HK	阿里影业	300	港市退补	10%	10%	324
1066.HK	威高股份	100	港市退补	10%	10%	1542
1088.HK	中国神华	100	港市退补	10%	10%	1406
1093.HK	石药集团	200	港市退补	10%	10%	1710
1099.HK	国药控股	100	港市退补	10%	10%	1920
1109.HK	华润置地	100	港市退补	10%	10%	3085
1113.HK	长实集团	100	港市退补	10%	10%	3860
1114.HK	BRILLIANCE CHI	100	港市退补	10%	10%	722
1128.HK	永利澳门	100	港市退补	10%	10%	1262
1177.HK	中国生物制药	300	港市退补	10%	10%	2283
1193.HK	华润燃气	100	港市退补	10%	10%	4040
1211.HK	比亚迪股份	100	港市退补	10%	10%	26700
1288.HK	农业银行	900	港市退补	10%	10%	2493
1299.HK	友邦保险	300	港市退补	10%	10%	29325
1313.HK	华润水泥控股	100	港市退补	10%	10%	877
1336.HK	新华保险	100	港市退补	10%	10%	2930
1398.HK	工商银行	2400	港市退补	10%	10%	11736
1548.HK	金斯瑞生物科技	100	港市退补	10%	10%	1246
1579.HK	颐海国际	100	港市退补	10%	10%	13540
1658.HK	邮储银行	300	港市退补	10%	10%	1659
1801.HK	信达生物	100	港市退补	10%	10%	9710
1810.HK	小米集团-W	400	港市退补	10%	10%	11580
1813.HK	合景泰富集团	100	港市退补	10%	10%	1048
1833.HK	平安好医生	100	港市退补	10%	10%	11140
1876.HK	百威亚太	100	港市退补	10%	10%	2520
1918.HK	融创中国	100	港市退补	10%	10%	2950
1928.HK	金沙中国有限公司	100	港市退补	10%	10%	3170
1929.HK	周大福	100	港市退补	10%	10%	966
1972.HK	太古地产	100	港市退补	10%	10%	2215
1988.HK	民生银行	200	港市退补	10%	10%	902
1997.HK	九龙仓置业	100	港市退补	10%	10%	4125
2007.HK	碧桂园	200	港市退补	10%	10%	1856
2018.HK	瑞声科技	100	港市退补	10%	10%	4240
2020.HK	安踏体育	100	港市退补	10%	10%	13760
2202.HK	万科企业	100	港市退补	10%	10%	2845
2269.HK	药明生物	100	港市退补	10%	10%	11760
2282.HK	美高梅中国	100	港市退补	10%	10%	1198



2313.HK	申洲国际	100	港市退补	10%	10%	16580
2318.HK	中国平安	200	港市退补	10%	10%	17960
2319.HK	蒙牛乳业	100	港市退补	10%	10%	4730
2328.HK	中国财险	200	港市退补	10%	10%	1152
2331.HK	李宁	100	港市退补	10%	10%	5075
2382.HK	舜宇光学科技	100	港市退补	10%	10%	22600
2388.HK	中银香港	100	港市退补	10%	10%	2295
2588.HK	中银航空租赁	100	港市退补	10%	10%	6515
2601.HK	中国太保	100	港市退补	10%	10%	3475
2628.HK	中国人寿	200	港市退补	10%	10%	3296
2688.HK	新奥能源	100	港市退补	10%	10%	12590
2689.HK	玖龙纸业	100	港市退补	10%	10%	1284
3311.HK	中国建筑国际	100	港市退补	10%	10%	471
3320.HK	华润医药	100	港市退补	10%	10%	437
3323.HK	中国建材	100	港市退补	10%	10%	977
3328.HK	交通银行	500	港市退补	10%	10%	2115
3333.HK	中国恒大	100	港市退补	10%	10%	1518
3380.HK	龙光集团	100	港市退补	10%	10%	1176
3383.HK	雅居乐集团	100	港市退补	10%	10%	1002
3690.HK	美团-W	100	港市退补	10%	10%	41420
3692.HK	翰森制药	100	港市退补	10%	10%	4315
3808.HK	中国重汽	100	港市退补	10%	10%	2655
3888.HK	金山软件	100	港市退补	10%	10%	6790
3908.HK	中金公司	100	港市退补	10%	10%	2105
3968.HK	招商银行	100	港市退补	10%	10%	6245
3988.HK	中国银行	2300	港市退补	10%	10%	6049
6030.HK	中信证券	100	港市退补	10%	10%	1780
6098.HK	碧桂园服务	100	港市退补	10%	10%	6905
6110.HK	滔搏	100	港市退补	10%	10%	1264
6186.HK	中国飞鹤	100	港市退补	10%	10%	2340
6808.HK	高鑫零售	100	港市退补	10%	10%	730
6862.HK	海底捞	100	港市退补	10%	10%	7785
6969.HK	思摩尔国际	100	港市退补	10%	10%	8010
9633.HK	农夫山泉	100	港市退补	10%	10%	6240
000001.SZ	平安银行	300	深市退补	10%	10%	7485
000002.SZ	万科 A	200	深市退补	10%	10%	5584
000050.SZ	深天马 A	100	深市退补	10%	10%	1659
000063.SZ	中兴通讯	100	深市退补	10%	10%	3194
000066.SZ	中国长城	100	深市退补	10%	10%	1670
000069.SZ	华侨城 A	100	深市退补	10%	10%	696
000100.SZ	TCL 科技	400	深市退补	10%	10%	3652
000157.SZ	中联重科	100	深市退补	10%	10%	1380
000166.SZ	申万宏源	300	深市退补	10%	10%	1419
000333.SZ	美的集团	200	深市退补	10%	10%	19528
000338.SZ	潍柴动力	100	深市退补	10%	10%	2407
000425.SZ	徐工机械	100	深市退补	10%	10%	619
000538.SZ	云南白药	100	深市退补	10%	10%	13260
000568.SZ	泸州老窖	100	深市退补	10%	10%	27900
000596.SZ	古井贡酒	100	深市退补	10%	10%	24140

000625.SZ	长安汽车	100	深市退补	10%	10%	1953
000627.SZ	天茂集团	100	深市退补	10%	10%	377
000651.SZ	格力电器	200	深市退补	10%	10%	11764
000656.SZ	金科股份	100	深市退补	10%	10%	731
000661.SZ	长春高新	100	深市退补	10%	10%	48913
000671.SZ	阳光城	100	深市退补	10%	10%	609
000703.SZ	恒逸石化	100	深市退补	10%	10%	1460
000708.SZ	中信特钢	100	深市退补	10%	10%	3359
000723.SZ	美锦能源	100	深市退补	10%	10%	758
000725.SZ	京东方 A	900	深市退补	10%	10%	5382
000728.SZ	国元证券	100	深市退补	10%	10%	799
000768.SZ	中航西飞	100	深市退补	10%	10%	3230
000776.SZ	广发证券	100	深市退补	10%	10%	1584
000783.SZ	长江证券	100	深市退补	10%	10%	749
000786.SZ	北新建材	100	深市退补	10%	10%	5220
000800.SZ	一汽解放	100	深市退补	10%	10%	1178
000858.SZ	五粮液	100	深市退补	10%	10%	30875
000860.SZ	顺鑫农业	100	深市退补	10%	10%	6426
000876.SZ	新希望	100	深市退补	10%	10%	2348
000895.SZ	双汇发展	100	深市退补	10%	10%	4833
000938.SZ	紫光股份	100	深市退补	10%	10%	2037
000961.SZ	中南建设	100	深市退补	10%	10%	760
000963.SZ	华东医药	100	深市退补	10%	10%	2605
000977.SZ	浪潮信息	100	深市退补	10%	10%	3080
000987.SZ	越秀金控	100	深市退补	10%	10%	1330
000999.SZ	华润三九	100	深市退补	10%	10%	2550
001979.SZ	招商蛇口	100	深市退补	10%	10%	1164
002001.SZ	新和成	100	深市退补	10%	10%	3832
002007.SZ	华兰生物	100	深市退补	10%	10%	4675
002008.SZ	大族激光	100	深市退补	10%	10%	4447
002013.SZ	中航机电	100	深市退补	10%	10%	1171
002024.SZ	苏宁易购	100	深市退补	10%	10%	680
002027.SZ	分众传媒	300	深市退补	10%	10%	3483
002032.SZ	苏泊尔	100	深市退补	10%	10%	7870
002044.SZ	美年健康	100	深市退补	10%	10%	1595
002049.SZ	紫光国微	100	深市退补	10%	10%	11767
002050.SZ	三花智控	100	深市退补	10%	10%	2406
002065.SZ	东华软件	100	深市退补	10%	10%	708
002081.SZ	金螳螂	100	深市退补	10%	10%	818
002120.SZ	韵达股份	100	深市退补	10%	10%	1815
002127.SZ	南极电商	100	深市退补	10%	10%	1078
002129.SZ	中环股份	100	深市退补	10%	10%	2798
002142.SZ	宁波银行	100	深市退补	10%	10%	4041
002146.SZ	荣盛发展	100	深市退补	10%	10%	598
002153.SZ	石基信息	100	深市退补	10%	10%	3290
002157.SZ	正邦科技	100	深市退补	10%	10%	1643
002179.SZ	中航光电	100	深市退补	10%	10%	7124
002180.SZ	纳思达	100	深市退补	10%	10%	2672
002185.SZ	华天科技	100	深市退补	10%	10%	1340

002202.SZ	金风科技	100	深市退补	10%	10%	1423
002230.SZ	科大讯飞	100	深市退补	10%	10%	4441
002236.SZ	大华股份	100	深市退补	10%	10%	2293
002241.SZ	歌尔股份	100	深市退补	10%	10%	3371
002252.SZ	上海莱士	100	深市退补	10%	10%	755
002271.SZ	东方雨虹	100	深市退补	10%	10%	5118
002294.SZ	信立泰	100	深市退补	10%	10%	3767
002299.SZ	圣农发展	100	深市退补	10%	10%	3047
002304.SZ	洋河股份	100	深市退补	10%	10%	20400
002311.SZ	海大集团	100	深市退补	10%	10%	6877
002352.SZ	顺丰控股	100	深市退补	10%	10%	10530
002371.SZ	北方华创	100	深市退补	10%	10%	19650
002373.SZ	千方科技	100	深市退补	10%	10%	1741
002384.SZ	东山精密	100	深市退补	10%	10%	2193
002385.SZ	大北农	100	深市退补	10%	10%	890
002399.SZ	海普瑞	100	深市退补	10%	10%	1952
002405.SZ	四维图新	100	深市退补	10%	10%	1652
002410.SZ	广联达	100	深市退补	10%	10%	8196
002414.SZ	高德红外	100	深市退补	10%	10%	4140
002415.SZ	海康威视	100	深市退补	10%	10%	5990
002422.SZ	科伦药业	100	深市退补	10%	10%	2036
002456.SZ	欧菲光	100	深市退补	10%	10%	1025
002460.SZ	赣锋锂业	100	深市退补	10%	10%	13062
002463.SZ	沪电股份	100	深市退补	10%	10%	1759
002468.SZ	申通快递	100	深市退补	10%	10%	949
002475.SZ	立讯精密	100	深市退补	10%	10%	5154
002493.SZ	荣盛石化	100	深市退补	10%	10%	3955
002508.SZ	老板电器	100	深市退补	10%	10%	3911
002555.SZ	三七互娱	100	深市退补	10%	10%	3162
002558.SZ	巨人网络	100	深市退补	10%	10%	1675
002594.SZ	比亚迪	100	深市退补	10%	10%	26300
002600.SZ	领益智造	100	深市退补	10%	10%	1028
002601.SZ	龙蟠佰利	100	深市退补	10%	10%	4292
002602.SZ	世纪华通	100	深市退补	10%	10%	650
002607.SZ	中公教育	100	深市退补	10%	10%	4000
002624.SZ	完美世界	100	深市退补	10%	10%	2645
002673.SZ	西部证券	100	深市退补	10%	10%	928
002714.SZ	牧原股份	100	深市退补	10%	10%	10702
002736.SZ	国信证券	100	深市退补	10%	10%	1233
002773.SZ	康弘药业	100	深市退补	10%	10%	3920
002812.SZ	恩捷股份	100	深市退补	10%	10%	13557
002821.SZ	凯莱英	100	深市退补	10%	10%	31700
002841.SZ	视源股份	100	深市退补	10%	10%	14190
002901.SZ	大博医疗	100	深市退补	10%	10%	5927
002916.SZ	深南电路	100	深市退补	10%	10%	10700
002926.SZ	华西证券	100	深市退补	10%	10%	987
002938.SZ	鹏鼎控股	100	深市退补	10%	10%	3945
002939.SZ	长城证券	100	深市退补	10%	10%	1140
002958.SZ	青农商行	100	深市退补	10%	10%	442

002966.SZ	苏州银行	100	深市退补	10%	10%	750
003816.SZ	中国广核	400	深市退补	10%	10%	1068
300003.SZ	乐普医疗	100	深市退补	10%	10%	2886
300014.SZ	亿纬锂能	100	深市退补	10%	10%	11212
300015.SZ	爱尔眼科	100	深市退补	10%	10%	7920
300033.SZ	同花顺	100	深市退补	10%	10%	14740
300059.SZ	东方财富	200	深市退补	10%	10%	7068
300070.SZ	碧水源	100	深市退补	10%	10%	721
300122.SZ	智飞生物	100	深市退补	10%	10%	17962
300124.SZ	汇川技术	100	深市退补	10%	10%	10142
300136.SZ	信维通信	100	深市退补	10%	10%	3009
300142.SZ	沃森生物	100	深市退补	10%	10%	4395
300144.SZ	宋城演艺	100	深市退补	10%	10%	1709
300146.SZ	汤臣倍健	100	深市退补	10%	10%	2189
300251.SZ	光线传媒	100	深市退补	10%	10%	1330
300253.SZ	卫宁健康	100	深市退补	10%	10%	1652
300308.SZ	中际旭创	100	深市退补	10%	10%	5035
300347.SZ	泰格医药	100	深市退补	10%	10%	18364
300383.SZ	光环新网	100	深市退补	10%	10%	1769
300408.SZ	三环集团	100	深市退补	10%	10%	4300
300413.SZ	芒果超媒	100	深市退补	10%	10%	8473
300433.SZ	蓝思科技	100	深市退补	10%	10%	3103
300450.SZ	先导智能	100	深市退补	10%	10%	9150
300454.SZ	深信服	100	深市退补	10%	10%	32400
300498.SZ	温氏股份	100	深市退补	10%	10%	1719
300529.SZ	健帆生物	100	深市退补	10%	10%	7942
300558.SZ	贝达药业	100	深市退补	10%	10%	13376
300601.SZ	康泰生物	100	深市退补	10%	10%	17740
300628.SZ	亿联网络	100	深市退补	10%	10%	8287
300661.SZ	圣邦股份	100	深市退补	10%	10%	28396
300676.SZ	华大基因	100	深市退补	10%	10%	14669
300750.SZ	宁德时代	100	深市退补	10%	10%	38098
300759.SZ	康龙化成	100	深市退补	10%	10%	15452
300760.SZ	迈瑞医疗	100	深市退补	10%	10%	46040
300782.SZ	卓胜微	100	深市退补	10%	10%	63847
300999.SZ	金龙鱼	100	深市退补	10%	10%	12116

说明：此处为示例，以届时实际公布为准

申购赎回清单的格式可根据上海证券交易所的系统升级相应调整，具体内容以基金管理人届时在网站上公布的实际内容为准。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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、外汇市场交易时间非正常停市，或港股通临时停市或遇公众节假日，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；

3、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；

5、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当，或者基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

6、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；

7、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；

8、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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

9、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限的情况；

10、港股通额度已满的情况下，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请；

11、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第6、9项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

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对价：

1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请或不能支付赎回对价；

2、证券/期货交易所、外汇市场交易时间非正常停市，或港股通临时停市或遇公众节假日，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况，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对价。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回对价；

4、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；

5、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；

6、发生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，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请；

7、当日赎回申请达到基金管理人设定的赎回份额上限的情况；

8、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当，或者基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

9、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生上述第 7 项以外的情形且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应当在当日报中国证监会备案。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付，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。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）基金份额的转让

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

#### （十一）基金的转托管、非交易过户、冻结、解冻等其他业务

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

#### （十二）其他

1、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，应在新的申购赎回安排实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在条件允许时可开放集合申购即允许多个投资者集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

3、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

4、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

5、对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

6、在条件允许的情况下，基金管理人未来可开通场外份额。在条件允许时，基金管理人也可在目前的申赎方式外，采取其他合理的申赎方式，并于新的申赎方式开始执行前的至少三个工作日予以公告。基金管理人有权制定相关业务规则。

在不违反法律法规的规定及基金合同的约定且对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，基金上市后，若上海证券交易所增加交易型开放式指数基金其他业务模式，基金管理人在与基金托管人协商一致后可增加本基金其他份额，无需召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案后公告。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、存托凭证、港股通标的股票及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

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

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或变更投资比例规定。

### （三）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 1、组合复制策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，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。

#### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、港股通额度受限、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

#### 3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期



以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 4、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 5、股指期货投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以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，以套期保值为目的，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。

#### 6、转融通投资策略

本基金在参与转融通证券出借业务时，基金管理人将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资。

#### 7、融资投资策略

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成的基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 8、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### （四）投资组合管理

本基金的指数化投资采用组合复制法，按照成份股在中证沪港深500指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

#### 1、标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变

动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

## 2、成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

## 3、标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

## 4、申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

## 5、跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### （五）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

（2）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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%；在任何交易日日终，持有的买入股指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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）；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；

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

- (4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (5) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (8) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (9) 本基金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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (10) 本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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (11) 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；
- (12) 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，与境内上市交易的股票合并计算；
- (13) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- (14) 本基金参与融资，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；
- (15) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：
  - 1) 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；
  - 2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；
  - 3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；
  - 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；
- (16) 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。

除上述第（7）、（10）、（11）、（15）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动

等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（14）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

## 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。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

### （六）标的指数

中证沪港深500指数。

中证沪港深500指数选取沪港深交易所上市的互联互通范围内股票作为指数样本股，以全面反映沪港深三地上市企业股票的整体表现。

### （七）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证沪港深500指数收益率。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有

实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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。

#### （八）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 十三、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### （四）估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券，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交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

④交易所上市交易的可转换债券以第三方估值机构提供的价格作为估值全价；

⑤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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

③对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

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

(4) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(5) 投资股指期货的估值方法

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) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(7) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(8) 本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

(9) 基金参与融资和转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。



(10) 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。

(11) 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。

(12) 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。

(13) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

(14) 税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### (五) 估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### (六) 估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或

投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，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方法如下：

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

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中

国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (七) 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确认后，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。

#### (八) 基金净值的确认

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

#### (九) 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(11)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所或登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十四、基金的收益分配

### （一）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；
- 3、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的原则和有关业务规则进行调整，并及时公告。

### （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 8、基金上市费、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 9、因投资港股通标的股票而产生各项合理费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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 5 个工作日内、按照指定的账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

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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 5 个工作日内、按照指定的账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、标的指数许可使用费

标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《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的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

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

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

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

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

#### 一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金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。

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

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

#### 二) 基金份额发售公告

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

#### 三) 《基金合同》生效公告

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

#### 四) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者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。

基金管理人应当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) 基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应提前将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

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

#### 六) 上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3

个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七) 申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、申购赎回代理券商网站或者营业网点公告当日的申购、赎回清单。

#### 八) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，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。

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。

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。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人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。

#### 九) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、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百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、本基金停复牌或终止上市；

21、本基金推出新业务或服务；

22、基金份额的折算；

23、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

24、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；

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规定的其它事项。

十) 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和基金上市交易的证券交易所。

十一) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

十二) 基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、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等。

#### 十三）基金投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### 十四）基金投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

#### 十五）基金参与融资和转融通证券出借交易的相关公告

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告等文件中披露基金参与转融通证券出借交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### 十六）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算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。

#### 十七）中国证监会规定的其他信息。

#### （六）信息披露事务管理

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

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

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披露信息的报刊。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，还可以根据需要在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。

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。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

#### （八）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。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

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

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

**经济周期风险：**随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

**利率风险：**金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 2、流动性风险

在市场或个券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、以合理成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

##### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

##### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、港股通标的股票及其他经中国证监会允许上市的其他股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。一般情况下本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障持有人利益的基础上，防范流动性风险。

##### （3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基

金管理人将在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值等流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能对投资者有以下潜在影响：投资者的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资者完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同；投资者接收赎回对价的时间将可能比一般正常情形下有所延迟等。

### 3、本基金特有风险

#### （1）指数化投资的风险

ETF 作为股票指数基金，在投资管理中会至少维持 90%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能规避市场下跌的风险和个股风险。

#### （2）二级市场流动性风险

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

#### （3）套利风险

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

#### （4）股指期货风险

本基金可投资股指期货，可能面临如下风险：

1) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

2) 基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

3) 股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影 响。

4) 期货盯市结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超

出预期的损失。

5) 到期日风险：股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

6) 对手方风险：基金管理人运用基金资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

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

8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

(5) 资产支持证券投资风险：本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(6) 参与融资业务的风险：本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

(7) 参与转融通证券出借业务的风险：本基金可参与转融通证券出借业务。转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。流动性风险是指本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因，发生无法及时变现并支付赎回款项的风险。信用风险是指本基金进行转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券、无法及时支付权益补偿及相关费用等导致基金资产损失的风险。市场风险是指本基金持有的证券出借后，可能出现出借期间无法及时处置证券，而证券价格持续下跌导致基金资产损失的风险。

#### (8) 科创板股票投资风险

本基金投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

1) 科创板上市公司股价波动较大的风险。科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他板块更为剧烈的波动；

2) 科创板上市公司退市的风险。科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且



不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，因此上市公司退市风险更大，可能会对基金净值产生不利影响；

3) 科创板股票流动性较差的风险。由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块活跃度可能弱于 A 股其他板块；科创板机构投资者占比较大，板块股票存在一致性预期的可能性高于 A 股其他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能；

4) 本基金投资集中度相对较高的风险。因科创板均为科技创新成长型公司，其商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持仓股票股价存在同向波动的可能，从而产生对基金净值不利的的影响。

#### (9) 港股通标的股票投资风险

本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。包括但不限于以下风险：

##### 1) 港股市场股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，因此每日涨跌幅空间相对较大，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，使基金面临较大的投资风险。

##### 2) 汇率风险

汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。本基金以人民币销售与结算，港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金港股投资部分的资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险；人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。

本基金投资港股通投资标的股票时，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，也使本基金投资面临汇率风险。同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

##### 3) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险

主要指在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险。具体而言，由于只有沪港或深港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，港股通交易日和交易时间由联交所证券交易服务公司在其指定网站公布，因此可能存在以下因港股通机制下交易日不连贯带来的风险：

①香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；

②出现上交所或深交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所或深交所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法

进行港股通交易的风险：

③投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，上交所或深交所另有规定的除外；

④投资者因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

#### 4) 港股因额度限制交易失败风险

港股通业务存在每日额度限制。在香港联交所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段或者收市竞价交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

#### 5) 交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中港股投资比例，造成比例超标的风险。

#### 6) 境外市场的其他相关风险。

本基金将通过港股通机制投资于香港市场，该机制在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

(10) 其它风险：本基金是跟踪中证沪港深 500 指数的交易型开放式指数基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：

#### 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目标股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个目标股票市场的平均报率可能存在偏离。

#### 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) 标的指数编制的风险

本基金的标的指数由指数提供商负责日常管理。指数提供商在编制、计算相关指数时没有义务顾及到本基金管理人和投资者的利益。指数提供商不保证标的指数的准确性和正确性，亦不保证在指数编制和计算时不会损害到本基金投资者和基金管理人的利益。

#### 4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪基准之间的偏离程度，是控制投资组合与基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。以下原因可能会影响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

- ①标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- ②标的指数成份股的调整；
- ③基金现金资产的拖累；
- ④基金的管理费、托管费和证券交易费用等带来的跟踪误差；
- ⑤指数成份股停牌、摘牌等因素带来的偏差；
- ⑥由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差；
- ⑦其他因素产生的偏离。如因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等。

#### 5) 标的指数变更的风险

根据基金合同的约定，如出现变更本基金标的指数的情形，经履行适当程序，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资策略将会改变，投资组合将随之调整，本基金的风险收益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

本基金的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，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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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并实施前，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。

#### 7) 基金份额二级市场交易价格折溢价风险

由于基金份额的二级市场交易价格受诸多因素影响，所以 ETF 存在着基金份额的二级市场交易价格（实时市价）与一级市场申购赎回价格（当日基金份额净值）之间存在偏离的可能性。

#### 8) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据

申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算,并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值(IOPV),供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。由于计算公式数据来源不同,IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异,与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异。IOPV计算还可能出现错误,投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失,需投资者自行承担。

#### 9) 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停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平;

③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,则该部分款项将按照约定方式进行结算(具体见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”之“6、申购、赎回清单的格式”相关约定),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。

④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符合要求的赎回对价,由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 10) 退市风险

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

#### 11) 投资者申购失败的风险

基金管理人有权根据本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的申购申请,从而导致申购失败。

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

#### 12) 投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时,如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价,可能导致赎回失败。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位,由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### 13) 基金份额赎回对价的变现风险

基金赎回对价主要为组合证券,在组合证券变现过程中,由于市场变化、部分成份股流

动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

#### 14) 申购赎回清单差错风险

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

#### 15) 退补现金替代方式的风险

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

#### 16) 申购赎回清单标识设置风险

基金管理人在进行申购赎回清单的现金替代标识设置时，将充分考虑由此引发的市场套利等行为对基金份额持有人可能造成的利益损害。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回清单标识设置的完全合理性。

#### 17) 第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

③证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### 4、存托凭证的投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

#### 5、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

#### 6、操作或技术风险

在开放式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人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

#### 7、合规性风险

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。

#### 8、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，投资者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。

#### 9、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

#### (二) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时

变现的，清算期限相应顺延。

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。



## 二十、基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

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

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的

发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

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

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

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

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

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

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

(22) 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;

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人, 投资者以股票认购的, 相关股票的解冻按照《业务规则》的规定处理;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者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或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 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；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或认购股票、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表

出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- （13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、为本基金增设新的份额类别；
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等在法律法规、基金合同规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；
- (6) 基金推出新业务或服务；
- (7) 按照指数编制公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费率、计算方法或支付方式；
- (8) 在不违反法律法规的情况下，本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，



现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 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、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电

话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

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

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

###### (2) 通讯开会

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

#### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除基金合同另有约定外,转换基金运作方式、更

换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

一同公告。

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

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理与基金托管人协商一致并提前公告后,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

#### (一) 《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

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

#### (三) 基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序:

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

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决，但若未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其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，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管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。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）名称：华宝基金管理有限公司  
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼  
法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）  
成立时间：2003年3月7日  
批准设立机关：中国证监会  
批准设立文号：证监基金字[2003]19号  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：1.5亿元人民币  
经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务  
存续期间：持续经营

### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司  
住所：北京市西城区复兴门内大街1号  
法定代表人：刘连舸  
成立时间：1983年10月31日  
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号  
批准设立机关及批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督:

1、基金管理人应将拟投资的中证沪港深500指数成份股及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化,对各投资品种的具体范围予以更新和调整,并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、港股通标的股票及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围或变更投资比例规定。

2、对基金投融资比例进行监督:

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;股指期货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。

基金的投资组合应遵循以下限制:

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

(2)本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合:

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%;在任何交易日日终,持有的买入股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;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%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等);

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

(4)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

证券规模的10%；

(6) 本基金管理人管理的且由本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%；

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

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

(9) 本基金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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(10) 本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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(11) 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；

(12) 基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

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

(14) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(15) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述第(7)、(10)、(11)、(14)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(14)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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。



法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

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

二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露登载基金业绩表现数据等进行复核。

三) 基金托管人在上述第一)、二) 款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

四) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

五) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

### (三) 基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、期货账户和证券账户、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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能

在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

#### （四）基金财产的保管

##### 一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，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、期货结算账户和证券账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

##### 三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

##### 四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

五) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。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、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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

六) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

七) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

八) 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管不低于法律法规规定的最低期限。

(五) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合

同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位以内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通知基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机构对前述内容另有规定的，按其规定处理。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、第三方估值机构等机构发送的数据错误，或由于不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金净值信息的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于20年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### （七）争议解决方式

一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，但若未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁双方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

##### 二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### 三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 二十二、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。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资者更改个人信息资料，请及时到原开立华宝基金账户的销售机构更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮箱地址的前提下，基金管理人将根据投资者的需要寄送以下资料：

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金份额持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服电话400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金份额持有人免费邮寄纸质对账单。

### 3、其他相关的信息资料

基金管理人以说明或电子形式向投资人寄送基金其他信息资料。

### （二）在线服务

基金管理人利用基金管理人的网站（www.fsfund.com）为基金投资者提供网上查询、网上资讯服务。

### （三）资讯服务

1、投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，4008205050，021-38924558，该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

传真：021-50499663、021-50988055

### 2、互联网站

网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

### （四）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

（五）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。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十三、其他应披露事项

无。

## 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

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

基金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。



## 二十五、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

(一) 中国证监会准予华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

(二) 《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(五) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(六) 法律意见书

(七) 注册登记协议

(八) 中国证监会要求的其他文件

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021年3月31日