

# 长信中证 500 指数增强型证券投资基金 更新的招募说明书

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二一年十月

## 重要提示

1、长信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 7 月 5 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1119 号文注册募集。基金合同于 2017 年 8 月 30 日正式生效。

2、基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

3、本基金标的指数为中证 500 指数。

### （1）样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、\*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

1) 科创板证券：上市时间超过一年。

2) 创业板证券：上市时间超过三年。

3) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

### （2）选样方法

1) 在样本空间中剔除沪深 300 指数样本以及过去一年日均总市值排名前 300 的证券；

2) 对样本空间内剩余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；

3) 将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前 500 的证券作为指数样本。

### （3）指数计算

指数计算公式为：

报告期指数 = 报告期样本的调整市值 / 除数 × 1000

其中，调整市值 =  $\sum$ （证券价格 × 调整股本数）。

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

4、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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券、期货市场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，利率风险，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，债券投资出现亏损的风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，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。

5、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

6、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

7、本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。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。

8、投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

9、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

11、本更新的招募说明书仅更新增设 C 类份额所涉及的相关内容，其他所载的内容截止日为 2021 年 3 月 31 日（其中基金管理人章节的信息截止日为 2021 年 10 月 25 日）。有关财务数据和净值截止日为 2020 年 12 月 31 日（财务数据经审计）。本基金托管人中国建设银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 目 录

一、绪言 .....	1
二、释 义 .....	2
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	18
五、相关服务机构 .....	21
六、基金的募集 .....	30
七、基金合同的生效 .....	31
八、基金份额的申购与赎回 .....	32
九、基金的投资组合报告 .....	44
十、基金的业绩 .....	66
十一、基金的投资 .....	67
十二、基金的财产 .....	75
十三、基金资产估值 .....	76
十四、基金费用与税收 .....	82
十五、基金的收益与分配 .....	86
十六、基金的会计与审计 .....	88
十七、基金的信息披露 .....	89
十八、侧袋机制 .....	96
十九、风险揭示 .....	100
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	108
二十一、基金合同的内容摘要 .....	110
二十二、基金托管协议的内容摘要 .....	140
二十三、基金份额持有人服务 .....	160
二十四、其他应披露事项 .....	163
二十五、招募说明书存放及查阅方式 .....	165
二十六、备查文件 .....	166

## 一、绪言

《长信中证 500 指数增强型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”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定，以及《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长信中证 500 指数增强型证券投资基金的投资目标、投资策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、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的资料申请募集的。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提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指长信中证 500 指数增强型证券投资基金
- 2、基金管理人：指长信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《长信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订、自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施

的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险规定》：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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、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

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、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、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指长信基金管理有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为长信基金管理有限责任公司或接受长信基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构



26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

28、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

29、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

30、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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日

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

34、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、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

37、《业务规则》：指长信基金管理有限责任公司及/或登记机构的相关业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，投资人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

39、申购：指基金合同生效后，投资人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

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、**基金转换**：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

42、**转托管**：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

43、**定期定额投资计划**：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、**巨额赎回**：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

45、**元**：指人民币元

46、**基金收益**：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

47、**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

48、**基金资产净值**：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、**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

50、**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

51、**基金份额类别**：指本基金根据登记机构、申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

52、**A 类基金份额、A 类份额**：指登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，且在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

53、**C 类基金份额、C 类份额**：指登记机构为长信基金管理有限责任公司，且在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

54、**销售服务费**:指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

55、**指定媒介**:指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站(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

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

57、**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

58、**基金产品资料概要**:指《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行

59、**侧袋机制**:指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算,目的在于有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待,属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间,原有账户称为主袋账户,专门账户称为侧袋账户

60、**特定资产**:包括:(1)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的资产;(2)按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;(3)其他资产价值存在重大不确定性的资产

61、**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

## 三、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼		
邮政编码	200120		
批准设立机关	中国证券监督管理委员会		
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63 号		
注册资本	壹亿陆仟伍佰万元人民币		
设立日期	2003 年 5 月 9 日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	刘元瑞		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
股权结构	<b>股东名称</b>	<b>出资额</b>	<b>出资比例</b>
	长江证券股份有限公司	7350 万元	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	31.21%
	武汉钢铁有限公司	2500.5 万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	751 万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	749 万元	4.54%
	总计	16500 万元	100%

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
刘元瑞	董事长	男	中共党员，硕士，现任长信基金管理有限责任公司董事长、长江证券股份有限公司党委副书记、董事、总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
陈谋亮	非独立董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海市湖北商会常务副会长，

			曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。
谢 辉	非独立董事	男	中共党员，硕士。现任武汉钢铁有限公司经营财务部部长。曾任武汉钢铁(集团)公司计划财务部会计处副主任科员、主任科员、处长，武汉钢铁(集团)公司企业管理部、运营改善部绩效考核处处长，武汉钢铁(集团)公司运营改善部绩效考核高级经理，武汉钢铁股份有限公司经营财务部副总经理，武汉钢铁有限公司经营财务部副部长。
覃波	非独立董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
徐志刚	独立董事	男	中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业(集团)有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询(上海)有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
刘 斐	独立董事	女	中共党员，工商管理硕士。现任国和创新教育基金(筹)合伙人。曾任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事(浦银安盛创始人)，上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事(浦发银行与新鸿基合资养老金投资管理公司)，浦发银行办公室负责人。
马晨光	独立董事	女	致公党党员，法律硕士。现任上海市协力律师事务所律师，管理合伙人，上海市浦东新区人大代表，中国致公党上海市浦东新区副主委，上海市法学会金融法研究会理事，上海国际仲裁中心仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，复旦大学研究生校外导师，华东政法大学校外兼职导师，上海对外经贸大学兼职教授，上海市浦东新区法律服务业协会副会长。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

## 2、监事会成员



监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科学历，正高职高级会计师。现任中国宝武钢铁集团有限公司监事、宝山钢铁股份有限公司监事、武汉钢铁有限公司监事。曾任武汉钢铁(集团)公司财务部机关费用科一科副科长、会计处主任科员，武汉钢铁(集团)公司公会财务部部长，武汉钢铁(集团)公司实业公司审计处处长、财务处处长，武汉钢铁(集团)公司计划财务部会计处处长，武汉钢铁股份公司计划财务部部长，武汉钢铁股份公司副总会计师兼计划财务部部长，武汉钢铁股份公司总会计师。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司财务负责人，兼任武汉股权托管交易中心监事长；曾任湖北证券有限公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理、执行副总裁、财务负责人、合规负责人、首席风险官。
朱锡峰	监事	男	中共党员，硕士，注册会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。历任湖南华菱钢铁集团有限责任公司科员、副科长、科长、财务主管，湖南华菱矿业投资有限公司财务总监，湖南华菱涟源钢铁有限公司财务部副部长兼涟源房地产公司财务总监，湖南国有资产经营管理有限公司财务管理部部长兼党支部书记，湖南博云新材料股份有限公司财务总监，湖南省财信产业基金管理有限公司首席财务官，上海海欣集团股份有限公司董秘处主任。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼综合行政部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司人力资源部总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司、综合行政部总监兼人力资源总监。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

### 3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方

			总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001 年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
安昀	副总经理、权益投资部总监	男	经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008 年 11 月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015 年 5 月 6 日至 2016 年 9 月 6 日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016 年 9 月 8 日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理、国际业务部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金和长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、权益投资部总监、长信内需成长混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金和长信内需均衡混合型证券投资基金的基金经理。
邓挺	副总经理	男	经济学、法学双学士，毕业于中南财经政法大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理。曾任富国基金管理有限公司渠道经理、高级渠道经理、华东营销中心渠道总监、华中营销中心总经理，长信基金管理有限责任公司机构业务部总监、保险业务部总监、总经理助理。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

#### 4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
宋海岸	量化研究部总监、基金经理	自 2018 年 2 月 13 日起至 今	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资部副总监、2018 年 3 月至 2018 年 5 月担任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理、2018 年 3 月至 2019 年 2 月担任长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理、2019 年 2 月至 2019 年 5 月担任长信价值优选混合型

			证券投资基金的基金经理、2018 年 8 月至 2019 年 9 月担任长信先优债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 1 月担任长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。现任量化研究部总监、2018 年 2 月至今担任长信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理、2018 年 2 月至今担任长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2019 年 5 月至今担任长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
常松	基金经理	自 2017 年 8 月 30 日起至 2018 年 9 月 8 日	曾任本基金的基金经理。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
安昀	副总经理、权益投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金和长信内需均衡混合型证券投资基金的基金经理
李家春	公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金和长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理
杨帆	养老 FOF 投资部总监、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）和长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理
高远	研究发展部总监、长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理
易利红	股票交易部总监
张文琍	固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
陆莹	现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理
叶松	总经理助理兼绝对收益部总监、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型



	证券投资基金和长信利信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
左金保	总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理
涂世涛	量化专户投资部总监兼投资经理
蔡军华	固收研究部总监
陈言午	专户投资部总监兼投资经理
宋海岸	量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理
冯彬	固收多策略部总监、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
崔飞燕	固收专户投资部总监兼投资经理
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>	

### (三) 基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、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、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或职务便利为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

（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、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的风险管理和内部控制制度

基金管理人高度重视内部风险控制，建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本基金的规范运作。

1、公司内部控制的总体目标

- （1）保证公司经营管理活动的合法合规性；
- （2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- （3）实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；
- （4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

2、内部控制制度遵循的原则

(1) 合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。

(2) 全面性原则：内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。

(3) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

(4) 独立性原则：公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司固有财产、基金财产和其他财产的运作应当分离。

(5) 相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(6) 防火墙原则：公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应当制定严格的审批程序和监管措施。

(7) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(8) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

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

(10) 保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

(11) 定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

### 3、内部风险控制体系结构

公司内控体系由不同层面的构成。公司董事会、经营管理层（包括督察长）、内部控制委员会、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

(1) 董事会：全面负责公司的风险控制工作，对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；

(2) 经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

(3) 内部控制委员会：协助经营管理层负责公司风险控制工作，主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度，协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会主要由公司经营管理层和业务部门负责人组成；

(4) 监察稽核部：负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况；对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核；对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查，并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

(5) 业务部门和公司各岗位：公司业务部门根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

#### 4、内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的内部风险控制制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成，按照其效力大小分为四个层面：

第一个层面是公司章程。

第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司自定各项规章制度的基础和依据，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

第三个层面是公司基本管理制度，它包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度，等等。

第四个层面是公司各部门业务规章、实施细则等。部门业务规章、实施细则是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作

守则等的具体说明。

公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### 5、内部风险管理体系

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、合规性风险以及不可抗力风险。

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

- (1) 投资风险的管理；
- (2) 交易风险管理；
- (3) 巨额赎回风险管理；
- (4) 基金注册登记风险管理；
- (5) 基金核算风险管理；
- (6) 市场开发风险管理；
- (7) 信息披露风险管理；
- (8) 不可抗力风险管理。

#### 6、风险管理和内部控制的措施

(1) 建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保各项业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立了明确的岗位分离制度，做到研究、决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，同时进行空间隔离，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密，从制度上降低和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每位员工都明确自己的任务、职责，及时上报各自工作领域中发现的风险隐患，以防范和化解风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了内部控制委员会，使用适合的程序和方法，确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险；建

立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策，减少风险造成的损失；

(5) 建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，不断提高员工素质和职业技能，防范和化解风险。

#### 7、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、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控制。



## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李莉

联系电话：(021)6063 7111

#### （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户服处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户

户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年及 2019 年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

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

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法



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

## （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 长信中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类销售机构

1	<b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
	法定代表人：刘元瑞	联系人：顾洵
	电话：021-61009916	传真：021-61009917
	客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
	<b>2、场外代销机构</b>	
1	交通银行股份有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	法定代表人：任德奇	联系人：高天
	电话：021-58781234	传真：021-58408483
	客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
2	招商银行股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	法定代表人：廖建民	联系人：季平伟
	电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
	客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
3	平安银行股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
	办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
	法定代表人：谢永林	联系人：赵杨
	电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
	客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
4	中国光大银行股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心	
	办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心	
	法定代表人：李晓鹏	联系人：沙牧楠
	电话：010-63639110	
	客户服务电话：95595	网址：www.cebbank.com

5	宁波银行股份有限公司	
	注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	法定代表人：陆华裕	联系人：王靖余
	电话：021-23262712	传真：021-63586853
	客户服务电话：95574	网址：www.nbcb.com.cn
6	安信证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
	办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	
	法定代表人：黄炎勋	联系人：陈剑虹
	电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
	客户服务电话：95517	网址：www.essence.com.cn
7	长江证券股份有限公司	
	注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
	办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	
	法定代表人：李新华	联系人：李良
	电话：027-65799999	传真：027-85481900
	客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
8	第一创业证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼	
	办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼	
	法定代表人：刘学民	联系人：吴军
	电话：0755-23838751	传真：0755-25831754
	客户服务电话：95358	网址：www.firstcapital.com.cn
9	光大证券股份有限公司	
	注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
	办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
	法定代表人：刘秋明	联系人：龚俊涛
	电话：021-22169999	传真：021-22169134
	客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
10	华福证券有限责任公司	
	注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	
	办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	
	法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
	电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
	客户服务电话：95547	网址：www.hfzq.com.cn

11	国金证券股份有限公司	
	注册地址：成都市东城根上街 95 号	
	办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
	法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
	电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
	客户服务电话：95310	网址：www.gjq.com.cn
12	国泰君安证券股份有限公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
	办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦	
	法人代表人：贺青	联系人：朱雅崑
	电话：021-38676666	传真：021-38670666
	客户服务热线：95521/4008888666	网址：www.gtja.com
13	平安证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
	办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	
	法定代表人：何之江	联系人：王阳
	电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
	客户服务电话：95511—8	网址：www.stock.pingan.com
14	中泰证券股份有限公司	
	注册地址：济南市市中区经七路 86 号	
	办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
	法定代表人：李峰	联系人：秦雨晴
	电话：021-20315197	传真：021-20315125
	客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn
15	申万宏源证券有限公司	
	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
	办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	
	法定代表人：杨玉成	联系人：黄莹
	电话：021-33389888	传真：021-33388224
	客户服务电话：95523 或 4008895523	网址：www.swhysc.com
16	天风证券股份有限公司	
	注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
	办公地址：中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
	法定代表人：余磊	联系人：程晓英
	电话：18064091773	传真：027-87618863
	客服电话：95391 或 400-800-5000	网址：www.tfzq.com

17	国融证券股份有限公司	
	注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼	
	办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层	
	法定代表人：张智河	联系人：叶密林
	电话：010-83991719	传真：010-66412537
	客户服务电话：95385	网址：www.grzq.com
18	兴业证券股份有限公司	
	注册地址：福州市湖东路 268 号	
	办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号	
	法定代表人：杨华辉	联系人：乔琳雪
	电话：021-38565547	
	客户服务电话：95562	网址：www.xyzq.com.cn
19	中国银河证券股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层	
	办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦	
	法定代表人：陈共炎	联系人：辛国政
	电话：010-80928123	
	客户服务电话：4008-888-888 或 95551	网址：www.chinastock.com.cn
20	中信期货有限公司	
	注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层	
	办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层	
	法定代表人：张皓	联系人：洪成
	电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
	客户服务电话：4009908826	网址：www.citicsf.com
21	中信证券股份有限公司	
	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
	办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦	
	法定代表人：张佑君	联系人：侯艳红
	电话：010-60838888	传真：010-60833739
	客户服务电话：95548；400-889-5548	网址：www.citics.com
22	中信证券（山东）有限责任公司	
	注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	
	办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层	
	法定代表人：冯恩新	联系人：焦刚
	电话：0531-89606166	传真：0532-85022605

	客户服务电话：95548	网址： <a href="http://sd.citics.com/">http://sd.citics.com/</a>
23	信达证券股份有限公司 注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼 法定代表人：祝瑞敏                      联系人：鹿馨方 电话：010-63081000                      传真：010-63080978 客服热线：95321                          网址： <a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>	
24	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼 法定代表人：祖国明                      联系人：韩爱彬 电话：0571-81137494                      传真：4000-766-123 客户服务电话：4000-766-123              网址： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>	
25	上海好买基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室 法定代表人：杨文斌                      联系人：徐超逸 电话：021-20613988                      传真：021-68596916 客户服务电话：4007009665              网址： <a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>	
26	上海天天基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 法定代表人：其实                          联系人：余强萍 电话：021-54509998                      传真：021-64385308 客户服务电话：400-1818-188              网址： <a href="http://fund.eastmoney.com">fund.eastmoney.com</a>	
27	上海陆金所基金销售有限公司 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼 法定代表人：陈祎彬                      联系人：宁博宇 电话：021-20665952                      传真：021-22066653 客户服务电话：4008219031              网址： <a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>	
28	上海联泰基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼 法定代表人：尹彬彬                      联系人：陈东 电话：021-52822063                      传真：021-52975270 客户服务电话：400-118-1188              网址： <a href="http://www.66zichan.com">www.66zichan.com</a>	

29	珠海盈米基金销售有限公司	
	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	
	办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203	
	法定代表人：肖雯	联系人：邱湘湘
	电话：020-89629099	传真：020-89629011
	客户服务电话：020-89629066	网站：www.yingmi.cn
30	北京汇成基金销售有限公司	
	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号	
	办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层	
	法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
	电话：010-56282140	传真：010-62680827
	客户服务电话：400-619-9059	网站：www.hcfunds.com
31	嘉实财富管理有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元	
	办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层	
	法定代表人：张峰	联系人：王宫
	电话：021-38789658	传真：021-68880023
	客户服务电话：400-600-8800	网站：www.jsfund.cn
32	北京蛋卷基金销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507	
	办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507	
	法定代表人：钟斐斐	联系人：侯芳芳
	电话：010-61840688	传真：010-84997571
	客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanapp.com
33	上海基煜基金销售有限公司	
	注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室	
	法定代表人：王翔	联系人：张巍婧
	电话：021-65370077-255	传真：021-55085991
	客户服务电话：400-820-5369	网站：www.jiyufund.com.cn
34	开源证券股份有限公司	
	注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	法定代表人：李刚	联系人：袁伟涛
	电话：029-88447611	传真：029-88447611
	客户服务电话：95325 或 400-860-8866	网站：www.kysec.cn



35	腾安基金销售（深圳）有限公司	
	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	
	办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦	
	法定代表人：刘明军	联系人：刘鸣
	电话：0755-86013388-77386	
	客户服务电话：4000-890-555；95017（拨通后转 1 转 8）	网站：www.tenganxinxi.com、www.txfund.com
36	江苏汇林保大基金销售有限公司	
	注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号	
	办公地址：南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室	
	法定代表人：吴言林	联系人：林伊灵
	电话：025-66046166（分机号转 810）	传真：025-53086966
	客户服务电话：025-66046166 转 849	网站：www.huilinbd.com
37	华鑫证券有限责任公司	
	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元	
	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号	
	法定代表人：俞洋	联系人：杨莉娟
	电话：021-54967552	传真：021-54967293
	客户服务电话：95323	网站：www.cfsc.com.cn
38	中国人寿保险股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融大街 16 号	
	办公地址：北京市西城区金融大街 16 号中国人寿广场	
	法定代表人：王滨	联系人：秦泽伟
	电话：010-63631752	传真：010-6622276
	客户服务电话：95519	网站：www.e-chinalife.com
39	民商基金销售（上海）有限公司	
	注册地址：上海市黄浦区北京东陆 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室	
	办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼	
	法定代表人：贲惠琴	联系人：林志枫
	电话：15626219801	传真：021-50206001
	客户服务电话：021-50206003	网站：www.msftec.com
40	泛华普益基金销售有限公司	
	注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室	
	办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 12 层	
	法定代表人：于海峰	联系人：隋亚方



	电话：13910181936	
	客户服务电话：400-080-3388	网站：www.puyifund.com
41	华融证券股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融大街 8 号	
	办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号	
	法定代表人：张海文	联系人：孙燕波
	电话：010-85556048	传真：010-85556088
	客户服务电话：95390	网站：www.hrsec.com.cn
42	中国中金财富证券有限公司	
	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元	
	办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18-21 层	
	法定代表人：高涛	
	客户服务电话：95532	
	网址：www.ciccwm.com	
43	恒泰证券股份有限公司	
	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	
	办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	
	法定代表人：庞介民	联系人：熊丽
	客户服务电话：956088	
	网址：www.cnht.com.cn	
44	京东肯特瑞基金销售有限公司	
	注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157	
	办公地址：北京市亦庄开发区科创 11 街 18 号京东大厦 A 座 15 层	
	法定代表人：李骏	联系人：隋斌
	客户服务电话：4000988511	传真：010-89189566
	网址：https://kenterui.jd.com/	
45	西部证券股份有限公司	
	注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室	
	办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室	
	法定代表人：徐朝晖	联系人：李阳
	客户服务电话：95582	传真：029-87406117
	网址：www.west95582.com	
46	东方财富证券股份有限公司	
	注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼	
	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦	
	法定代表人：戴彦	联系人：陈亚男

客服电话：95357	传真：021-23586860
公司网站： <a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a>	

### 长信中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类销售机构

1	<b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
	法定代表人：刘元瑞	联系人：顾洵
	电话：021-61009916	传真：021-61009917
	客户服务电话：400-700-5566	公司网站： <a href="http://www.cxfund.com.cn">www.cxfund.com.cn</a>

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

### （二）其他相关机构

信息类型	A 类注册登记机构	C 类注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	长信基金管理有限责任公司	上海源泰律师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
法定代表人	周明	刘元瑞	廖海（负责人）	曾顺福
联系电话	010-59378856	021-61009999	021-51150298	021-61418888
传真	010-59378907	021-61009800	021-51150398	021-61411909
联系人	崔巍	孙红辉	刘佳、姜亚萍	曾浩（曾浩、冯适为经办注册会计师）

## 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》、《信息披露办法》等有关规定及基金合同,并经中国证监会 2017 年 7 月 5 日证监许可【2017】1119 号文注册募集。

本基金募集期自 2017 年 8 月 1 日至 2017 年 8 月 23 日止。经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算,基金募集期共募集长信中证 500 指数增强型证券投资基金(含利息结转份额) 210,352,867.81 份基金份额,有效认购户数为 289 户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定，本基金符合基金合同生效的条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2017 年 8 月 30 日获得证监会书面确认，基金合同从即日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构名单将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。

基金管理人可根据情况针对某类份额变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 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。

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》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金已于 2017 年 9 月 5 日开始办理日常申购赎回业务。

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

### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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。

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。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项。投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往投资人银行账户。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购



或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效,则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请及申购份额、赎回金额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

在法律法规允许的范围内,本基金登记机构可根据相关业务规则,对上述业务办理时间进行调整,本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

#### (五) 申购和赎回的数量限制

1、投资人办理本基金申购时,首次申购的单笔最低金额为人民币1元(含申购费,下同),追加申购的单笔最低金额为人民币1元;超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资人通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金遵循上述规则;各代销机构有不同规定的,投资人在该代销机构办理申购业务时,需同时遵循该代销机构的相关规定。

2、投资人当期分配的基金收益转购基金份额时,不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整本基金首次申购的最低金额。

3、基金份额持有人在销售机构赎回本基金的单笔赎回申请不得低于1份基金份额,基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)单个交易账户保留的基金份额余额不足1份的,余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

4、本基金管理人可以规定单个投资人累计持有的份额上限、单笔/单日申购金额上限、本基金总规模上限,具体规定届时以更新的招募说明书或相关公告为准。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,

具体请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

#### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费用

投资者申购本基金 A 类基金份额时交纳申购费用；申购本基金 C 类基金份额时，无需交纳申购费。申购费用按申购金额采用比例费率或固定费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

基金份额	申购金额 (M, 含申购费)	前端申购费率
A 类基金份额	M < 100 万元	1.5%
	100 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元
C 类基金份额	0	

注：M 为申购金额

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

##### 2、赎回费用

本基金赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

持有时间 (Y)	A 类赎回费率	持有时间 (Y)	C 类赎回费率
Y < 7 天	1.5%	Y < 7 天	1.5%
7 天 ≤ Y < 30 天	0.5%	7 天 ≤ Y < 30 天	0.5%
30 天 ≤ Y < 1 年	0.3%		
1 年 ≤ Y < 2 年	0.1%	30 天 ≤ Y	0
Y ≥ 2 年	0%		

注：Y 为持有期限

3、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回时收取。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归入基金财产的部分用于

支付注册登记费和其他必要的手续费。

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

### （七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购份额、余额的处理方式：各类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日该类基金份额净值为基准计算，有效份额单位为份。四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 3、申购份额的计算

（1）基金的 A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，本基金 A 类基金份额的申购份额计算公式为：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率），或净申购金额=申购金额-固定申购费金额

申购费用=申购金额-净申购金额，或申购费用=固定申购费金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

（2）C 类基金份额的申购份额计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

例 1：某投资者投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，对应的申购费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0520 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/(1+1.5%)=49,261.08 元

申购费用=50,000-49,261.08=738.92 元

投资者可得到的 A 类基金份额申购份额为  $(49,261.08/1.0520) = 46,826.12$  份；

#### 4、赎回金额的计算

若投资者赎回本基金基金份额，则赎回金额的计算公式为：

赎回总额 = 赎回份额 × 赎回当日该类基金基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

例 2：某投资者持有本基金 10 万份 A 类基金份额 2 年后赎回，赎回费率为 0%，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.2000 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 =  $100,000 \times 1.2000 = 120,000$  元

赎回费用 =  $120,000 \times 0\% = 0$  元

赎回金额 =  $120,000 - 0 = 120,000$  元

即投资者持有本基金 10 万份 A 类基金份额 2 年后赎回，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2000 元，则其可得到的赎回金额为 120,000 元。

#### 5、基金份额净值的计算公式为：

某类基金份额净值 = 该类基金资产净值总额 ÷ 该类基金份额总数。

本基金分为 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金两类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 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，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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

8、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且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。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

6、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形第 1、2、3、5、6、7 之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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。若出现上述第 4

项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### (十) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人有权对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20% 以上的那部分赎回申请进行延期办理；对该基金份额持有人未超过上



述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

#### （十二）基金转换

本公司已开通了长信中证 500 指数基金与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信低碳环保股票基金、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信恒利优势混合基金、长信双利混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金（非直销渠道）、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信



利保债券基金 A 类份额（A 类代码：519947）、长信利泰混合基金 A 类份额（A 类代码：519951）、长信利泰混合基金 C 类份额（C 类代码：007863）、长信先锐混合基金 A 类份额（A 类代码：519937）、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信利信混合基金 A 类份额（A 类代码：519949）、长信先优债券基金、长信乐信混合基金（非直销渠道）、长信创新驱动股票基金、长信合利混合基金、长信利率债债券基金、长信消费精选股票基金（非直销渠道）和长信价值优选混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

1、投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

2、转换份额的计算公式：

（1）非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

（若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零）

（2）货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

（货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费）

### (3) 非货币基金转至货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值

赎回费 = 转出确认金额 × 赎回费率

转入确认金额 = 转出确认金额 - 赎回费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 货币基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元, 补差费为零)

### (十三) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下, 接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人, 或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

继承是指基金份额持有人死亡, 其持有的基金份额由其合法的继承人继承; 捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体; 司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料, 对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理, 并按基金登记机构规定的标准收费, 接受划转的主体应为依法可持有本基金份额的合格投资者。

### (十四) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管, 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### (十五) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划, 具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额, 每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

### (十六) 基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻, 以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额

被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规或监管部门另有规定的除外。

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

#### （十七）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者通过其他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。

#### （十八）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

（十九）在不违反相关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，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 九、基金的投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 4 月复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 12 月 31 日（摘自本基金 2020 年年报），本报告中所列财务数据经审计。

### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	200,812,317.31	93.50
	其中：股票	200,812,317.31	93.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,393,954.77	6.24
8	其他资产	576,279.13	0.27
9	合计	214,782,551.21	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

**1、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,881,190.57	3.23
C	制造业	109,164,486.30	51.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,010,923.00	3.29
E	建筑业	5,740,653.13	2.69
F	批发和零售业	5,542,470.00	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	3,262,688.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,549,362.82	4.94
J	金融业	5,768,468.00	2.70
K	房地产业	5,389,046.44	2.53
L	租赁和商务服务业	2,826.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	900.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,552.00	0.01
Q	卫生和社会工作	7,298,760.00	3.42
R	文化、体育和娱乐业	1,236.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	166,626,562.26	78.10

**2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	449.00	0.00
C	制造业	26,102,595.55	12.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,636,994.00	0.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,968,913.44	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	8,259.92	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,866.99	0.04
J	金融业	1,760,620.03	0.83

K	房地产业	10,071.02	0.00
L	租赁和商务服务业	976,748.08	0.46
M	科学研究和技术服务业	40,048.80	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	72,241.34	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,508,840.00	0.71
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,106.88	0.00
S	综合	-	-
	合计	34,185,755.05	16.02

### 3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

#### (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603486	科沃斯	62,800	5,557,172.00	2.60
2	300274	阳光电源	68,800	4,972,864.00	2.33
3	603882	金域医学	34,600	4,432,952.00	2.08
4	300496	中科创达	35,700	4,176,900.00	1.96
5	600409	三友化工	404,400	4,145,100.00	1.94
6	002080	中材科技	165,800	4,009,044.00	1.88
7	000600	建投能源	707,700	3,970,197.00	1.86
8	603317	天味食品	43,900	3,610,336.00	1.69
9	600765	中航重机	141,900	3,547,500.00	1.66
10	601966	玲珑轮胎	98,300	3,457,211.00	1.62
11	002920	德赛西威	39,200	3,298,288.00	1.55
12	600985	淮北矿业	292,400	3,271,956.00	1.53
13	601000	唐山港	1,315,600	3,262,688.00	1.53
14	300115	长盈精密	128,700	3,172,455.00	1.49
15	601799	星宇股份	15,403	3,088,301.50	1.45

16	603444	吉比特	7,200	3,067,200.00	1.44
17	000543	皖能电力	727,100	3,039,278.00	1.42
18	600500	中化国际	574,000	3,024,980.00	1.42
19	600143	金发科技	176,300	3,021,782.00	1.42
20	002382	蓝帆医疗	142,900	3,013,761.00	1.41
21	000932	华菱钢铁	628,800	3,005,664.00	1.41
22	002223	鱼跃医疗	106,400	3,001,544.00	1.41
23	002557	洽洽食品	55,600	2,994,060.00	1.40
24	603345	安井食品	15,500	2,989,485.00	1.40
25	600195	中牧股份	232,667	2,980,464.27	1.40
26	600901	江苏租赁	539,200	2,970,992.00	1.39
27	000581	威孚高科	127,839	2,964,586.41	1.39
28	601615	明阳智能	155,300	2,947,594.00	1.38
29	600216	浙江医药	215,900	2,936,240.00	1.38
30	600039	四川路桥	647,551	2,920,455.01	1.37
31	002372	伟星新材	155,779	2,913,067.30	1.37
32	002281	光迅科技	99,400	2,886,576.00	1.35
33	603866	桃李面包	48,800	2,884,080.00	1.35
34	000983	山西焦煤	510,000	2,876,400.00	1.35
35	300244	迪安诊断	83,600	2,865,808.00	1.34
36	002244	滨江集团	622,800	2,858,652.00	1.34
37	002705	新宝股份	67,600	2,856,100.00	1.34
38	600808	马钢股份	1,073,600	2,855,776.00	1.34
39	600567	山鹰国际	940,400	2,840,008.00	1.33
40	600820	隧道股份	521,000	2,818,610.00	1.32
41	600643	爱建集团	371,600	2,794,432.00	1.31
42	000501	鄂武商A	239,200	2,786,680.00	1.31
43	600388	龙净环保	310,710	2,759,104.80	1.29
44	600153	建发股份	335,600	2,755,276.00	1.29
45	002511	中顺洁柔	130,842	2,730,672.54	1.28
46	002174	游族网络	205,400	2,703,064.00	1.27
47	603816	顾家家居	38,200	2,693,482.00	1.26
48	000807	云铝股份	357,600	2,692,728.00	1.26
49	000513	丽珠集团	66,420	2,690,010.00	1.26



50	002156	通富微电	100,300	2,531,572.00	1.19
51	600657	信达地产	623,900	2,526,795.00	1.18
52	002233	塔牌集团	114,785	1,462,360.90	0.69
53	600038	中直股份	16,400	1,028,444.00	0.48
54	600339	中油工程	233,200	718,256.00	0.34
55	601003	柳钢股份	135,274	702,072.06	0.33
56	002434	万里扬	54,600	487,032.00	0.23
57	002544	杰赛科技	26,500	444,670.00	0.21
58	600967	内蒙一机	12,800	155,648.00	0.07
59	600804	鹏博士	21,400	143,808.00	0.07
60	300618	寒锐钴业	900	85,419.00	0.04
61	002709	天赐材料	320	33,216.00	0.02
62	002901	大博医疗	300	22,119.00	0.01
63	603638	艾迪精密	200	13,788.00	0.01
64	603377	东方时尚	700	13,552.00	0.01
65	600486	扬农化工	100	13,200.00	0.01
66	002155	湖南黄金	1,300	11,063.00	0.01
67	002831	裕同科技	349	10,686.38	0.01
68	600779	水井坊	100	8,302.00	0.00
69	600446	金证股份	500	8,105.00	0.00
70	002242	九阳股份	218	6,984.72	0.00
71	603198	迎驾贡酒	200	6,980.00	0.00
72	300207	欣旺达	200	6,142.00	0.00
73	600862	中航高科	190	5,719.00	0.00
74	600885	宏发股份	100	5,422.00	0.00
75	300630	普利制药	112	4,691.68	0.00
76	603712	七一二	100	4,165.00	0.00
77	600060	海信视像	300	3,444.00	0.00
78	002387	维信诺	300	3,420.00	0.00
79	002056	横店东磁	200	3,038.00	0.00
80	601717	郑煤机	276	3,016.68	0.00
81	300316	晶盛机电	100	3,008.00	0.00
82	002818	富森美	200	2,826.00	0.00
83	002465	海格通信	200	2,166.00	0.00

84	300418	昆仑万维	100	1,995.00	0.00
85	002867	周大生	70	1,865.50	0.00
86	300315	掌趣科技	362	1,849.82	0.00
87	002635	安洁科技	100	1,723.00	0.00
88	600064	南京高科	160	1,643.20	0.00
89	000877	天山股份	100	1,510.00	0.00
90	000050	深天马A	100	1,474.00	0.00
91	601139	深圳燃气	200	1,448.00	0.00
92	600380	健康元	100	1,391.00	0.00
93	600649	城投控股	248	1,346.64	0.00
94	601958	金钼股份	200	1,242.00	0.00
95	300133	华策影视	200	1,236.00	0.00
96	000975	银泰黄金	137	1,179.57	0.00
97	002273	水晶光电	100	1,159.00	0.00
98	600291	西水股份	200	1,134.00	0.00
99	603338	浙江鼎力	11	1,113.09	0.00
100	002128	露天煤业	100	1,094.00	0.00
101	600782	新钢股份	233	1,069.47	0.00
102	300459	金科文化	300	957.00	0.00
103	600166	福田汽车	300	945.00	0.00
104	002266	浙富控股	200	900.00	0.00
105	000090	天健集团	148	879.12	0.00
106	002807	江阴银行	200	856.00	0.00
107	600633	浙数文化	100	814.00	0.00
108	002051	中工国际	100	709.00	0.00
109	600266	城建发展	120	609.60	0.00
110	600908	无锡银行	100	608.00	0.00
111	002640	跨境通	100	514.00	0.00
112	002936	郑州银行	100	446.00	0.00
113	600022	山东钢铁	100	143.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	002475	立讯精密	57,978	3,253,725.36	1.53
2	300782	卓胜微	4,800	2,738,592.00	1.28
3	002258	利尔化学	108,500	2,267,650.00	1.06
4	601677	明泰铝业	150,739	2,131,449.46	1.00
5	300638	广和通	35,400	2,118,690.00	0.99
6	300415	伊之密	152,000	2,035,280.00	0.95
7	300639	凯普生物	53,400	2,006,772.00	0.94
8	000759	中百集团	313,900	1,939,902.00	0.91
9	300502	新易盛	33,600	1,864,128.00	0.87
10	603686	龙马环卫	114,200	1,836,336.00	0.86
11	300119	瑞普生物	96,800	1,827,584.00	0.86
12	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.80
13	600011	华能国际	365,300	1,636,544.00	0.77
14	002621	美吉姆	268,000	1,508,840.00	0.71
15	603218	日月股份	34,482	1,043,080.50	0.49
16	002878	元隆雅图	47,440	975,366.40	0.46
17	002139	拓邦股份	88,600	718,546.00	0.34
18	688390	固德威	1,381	306,195.32	0.14
19	603043	广州酒家	4,800	185,904.00	0.09
20	688595	芯海科技	2,735	165,713.65	0.08
21	002241	歌尔股份	4,400	164,208.00	0.08
22	300883	龙利得	8,911	125,199.55	0.06
23	300903	科翔股份	3,649	111,185.03	0.05
24	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.04
25	300999	金龙鱼	1,075	94,911.75	0.04
26	300865	大宏立	2,473	92,045.06	0.04
27	688560	明冠新材	2,857	65,311.02	0.03
28	688578	艾力斯	2,460	60,983.40	0.03
29	002821	凯莱英	200	59,828.00	0.03
30	688617	惠泰医疗	803	59,791.38	0.03
31	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.02
32	688221	前沿生物	2,993	51,329.95	0.02
33	300896	爱美客	76	45,855.36	0.02
34	300033	同花顺	359	44,508.82	0.02
35	300926	博俊科技	3,375	36,315.00	0.02

36	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
37	603127	昭衍新药	280	28,870.80	0.01
38	300124	汇川技术	300	27,990.00	0.01
39	300900	广联航空	668	22,150.88	0.01
40	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
41	300558	贝达药业	200	21,474.00	0.01
42	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
43	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
44	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
45	600570	恒生电子	169	17,728.10	0.01
46	300624	万兴科技	300	16,617.00	0.01
47	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
48	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
49	300394	天孚通信	300	15,999.00	0.01
50	300894	火星人	423	15,638.31	0.01
51	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
52	300867	圣元环保	450	14,386.50	0.01
53	300913	兆龙互连	599	14,340.06	0.01
54	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
55	002049	紫光国微	100	13,381.00	0.01
56	300892	品渥食品	214	12,842.14	0.01
57	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
58	000561	烽火电子	1,700	12,189.00	0.01
59	300877	金春股份	228	11,593.80	0.01
60	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
61	300887	谱尼测试	150	11,178.00	0.01
62	300902	国安达	441	10,698.66	0.01
63	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
64	300872	天阳科技	281	10,633.04	0.00
65	300861	美畅股份	197	10,066.70	0.00
66	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
67	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
68	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
69	300879	大叶股份	333	9,030.96	0.00
70	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00

71	300925	法本信息	237	8,847.21	0.00
72	300876	蒙泰高新	241	8,825.42	0.00
73	300908	仲景食品	146	8,824.24	0.00
74	300910	瑞丰新材	174	8,329.38	0.00
75	300889	爱克股份	275	8,283.00	0.00
76	300860	锋尚文化	64	8,106.88	0.00
77	300878	维康药业	166	8,087.52	0.00
78	603799	华友钴业	100	7,930.00	0.00
79	603233	大参林	100	7,835.00	0.00
80	300909	汇创达	188	7,645.96	0.00
81	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
82	300873	海晨股份	176	7,272.32	0.00
83	300868	杰美特	167	7,227.76	0.00
84	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
85	300911	亿田智能	189	6,248.34	0.00
86	002409	雅克科技	100	6,009.00	0.00
87	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
88	300864	南大环境	62	5,632.70	0.00
89	002531	天顺风能	600	5,052.00	0.00
90	002669	康达新材	300	4,941.00	0.00
91	600276	恒瑞医药	40	4,458.40	0.00
92	002829	星网宇达	100	4,318.00	0.00
93	300737	科顺股份	200	4,292.00	0.00
94	300596	利安隆	100	3,928.00	0.00
95	300206	理邦仪器	200	3,650.00	0.00
96	603939	益丰药房	40	3,607.60	0.00
97	600605	汇通能源	300	3,603.00	0.00
98	603609	禾丰牧业	300	3,546.00	0.00
99	300451	创业慧康	250	3,382.50	0.00
100	603238	诺邦股份	100	3,175.00	0.00
101	002555	三七互娱	100	3,123.00	0.00
102	002585	双星新材	300	3,018.00	0.00
103	000800	一汽解放	200	2,336.00	0.00
104	600496	精工钢构	500	2,240.00	0.00
105	000625	长安汽车	100	2,188.00	0.00

106	002365	永安药业	200	1,876.00	0.00
107	300019	硅宝科技	100	1,729.00	0.00
108	000416	民生控股	300	1,728.00	0.00
109	600075	新疆天业	303	1,711.95	0.00
110	000059	华锦股份	300	1,656.00	0.00
111	603606	东方电缆	63	1,571.85	0.00
112	002127	南极电商	101	1,381.68	0.00
113	300203	聚光科技	100	1,167.00	0.00
114	002697	红旗连锁	170	1,123.70	0.00
115	603566	普莱柯	53	1,098.69	0.00
116	000885	城发环境	60	699.60	0.00
117	000671	阳光城	100	652.00	0.00
118	000521	长虹美菱	100	606.00	0.00
119	600795	国电电力	200	450.00	0.00
120	600583	海油工程	100	449.00	0.00
121	600716	凤凰股份	108	443.88	0.00
122	600017	日照港	100	288.00	0.00

#### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300244	迪安诊断	9,393,926.02	15.20
2	601003	柳钢股份	8,325,139.14	13.47
3	002233	塔牌集团	6,993,233.60	11.31
4	600039	四川路桥	6,793,857.72	10.99
5	600339	中油工程	6,561,491.00	10.61
6	600143	金发科技	6,251,148.00	10.11
7	002465	海格通信	6,185,000.00	10.01
8	002156	通富微电	6,064,403.00	9.81
9	002511	中顺洁柔	6,027,507.13	9.75
10	002127	南极电商	5,736,426.68	9.28
11	601799	星宇股份	5,410,652.49	8.75
12	002174	游族网络	5,322,483.00	8.61
13	300558	贝达药业	5,199,897.60	8.41

14	300033	同花顺	5,187,370.94	8.39
15	600862	中航高科	5,172,224.20	8.37
16	600643	爱建集团	5,135,412.14	8.31
17	002382	蓝帆医疗	5,076,311.00	8.21
18	600266	城建发展	5,058,272.00	8.18
19	601717	郑煤机	4,959,011.00	8.02
20	600060	海信视像	4,959,007.00	8.02
21	603233	大参林	4,841,638.62	7.83
22	601816	京沪高铁	4,820,220.00	7.80
23	300119	瑞普生物	4,774,371.00	7.72
24	002475	立讯精密	4,711,874.34	7.62
25	600195	中牧股份	4,465,609.60	7.22
26	000543	皖能电力	4,448,906.00	7.20
27	000581	威孚高科	4,371,930.22	7.07
28	002831	裕同科技	4,313,739.00	6.98
29	603806	福斯特	4,299,071.00	6.95
30	002640	跨境通	4,270,062.00	6.91
31	300115	长盈精密	4,264,441.00	6.90
32	002555	三七互娱	4,230,823.63	6.84
33	603486	科沃斯	4,223,409.03	6.83
34	002244	滨江集团	4,170,233.41	6.75
35	002557	洽洽食品	4,152,563.00	6.72
36	600901	江苏租赁	4,138,603.00	6.70
37	601615	明阳智能	4,136,842.00	6.69
38	601966	玲珑轮胎	4,116,797.74	6.66
39	002281	光迅科技	4,108,044.21	6.65
40	002372	伟星新材	4,104,140.10	6.64
41	603345	安井食品	4,063,457.00	6.57
42	002507	涪陵榨菜	4,040,314.00	6.54
43	300315	掌趣科技	3,990,140.50	6.45
44	002139	拓邦股份	3,982,168.00	6.44
45	300207	欣旺达	3,970,964.00	6.42
46	600216	浙江医药	3,912,393.00	6.33
47	600500	中化国际	3,910,347.00	6.33
48	002440	闰土股份	3,839,880.00	6.21



49	000600	建投能源	3,825,626.00	6.19
50	603816	顾家家居	3,822,821.00	6.18
51	603606	东方电缆	3,819,163.24	6.18
52	300124	汇川技术	3,803,797.00	6.15
53	600757	长江传媒	3,789,413.00	6.13
54	002258	利尔化学	3,720,850.00	6.02
55	000807	云铝股份	3,712,173.00	6.01
56	002223	鱼跃医疗	3,702,562.00	5.99
57	603317	天味食品	3,644,210.57	5.90
58	300482	万孚生物	3,591,013.50	5.81
59	300502	新易盛	3,581,168.36	5.79
60	002635	安洁科技	3,554,338.32	5.75
61	000975	银泰黄金	3,540,421.54	5.73
62	603218	日月股份	3,534,570.98	5.72
63	300012	华测检测	3,504,633.11	5.67
64	600820	隧道股份	3,445,930.00	5.57
65	600298	安琪酵母	3,440,194.43	5.57
66	600064	南京高科	3,432,622.40	5.55
67	000690	宝新能源	3,355,174.00	5.43
68	002878	元隆雅图	3,354,083.71	5.43
69	002056	横店东磁	3,316,819.00	5.37
70	000739	普洛药业	3,316,552.00	5.37
71	002138	顺络电子	3,311,778.00	5.36
72	600053	九鼎投资	3,307,652.00	5.35
73	603566	普莱柯	3,306,731.44	5.35
74	300638	广和通	3,304,749.40	5.35
75	002653	海思科	3,302,454.00	5.34
76	601000	唐山港	3,283,608.00	5.31
77	002821	凯莱英	3,278,136.24	5.30
78	600388	龙净环保	3,211,587.40	5.20
79	600716	凤凰股份	3,206,357.00	5.19
80	600011	华能国际	3,192,743.00	5.16
81	002624	完美世界	3,167,276.08	5.12
82	600166	福田汽车	3,165,633.00	5.12
83	002155	湖南黄金	3,154,902.00	5.10

84	600567	山鹰国际	3,144,283.00	5.09
85	600765	中航重机	3,127,784.00	5.06
86	000932	华菱钢铁	3,108,954.80	5.03
87	000513	丽珠集团	3,096,519.73	5.01
88	600808	马钢股份	3,088,705.00	5.00
89	601678	滨化股份	3,079,818.00	4.98
90	600153	建发股份	3,078,242.00	4.98
91	002807	江阴银行	3,072,368.00	4.97
92	002867	周大生	3,071,628.30	4.97
93	002080	中材科技	3,053,330.78	4.94
94	601333	广深铁路	3,047,710.50	4.93
95	300274	阳光电源	3,047,601.00	4.93
96	600649	城投控股	3,043,040.28	4.92
97	600409	三友化工	3,037,795.29	4.91
98	002705	新宝股份	3,033,863.00	4.91
99	300418	昆仑万维	3,026,497.00	4.90
100	002901	大博医疗	3,001,765.00	4.86
101	600985	淮北矿业	2,995,184.00	4.85
102	600026	中远海能	2,986,175.00	4.83
103	600694	大商股份	2,979,040.00	4.82
104	603882	金城医学	2,953,828.00	4.78
105	603686	龙马环卫	2,944,187.00	4.76
106	600845	宝信软件	2,913,211.00	4.71
107	000863	三湘印象	2,905,652.08	4.70
108	000501	鄂武商 A	2,892,255.00	4.68
109	603444	吉比特	2,885,693.00	4.67
110	300496	中科创达	2,817,312.00	4.56
111	002028	思源电气	2,807,402.00	4.54
112	300639	凯普生物	2,770,694.00	4.48
113	002595	豪迈科技	2,762,144.00	4.47
114	000983	山西焦煤	2,758,972.00	4.46
115	603712	七一二	2,735,720.00	4.43
116	300630	普利制药	2,712,346.00	4.39
117	002214	大立科技	2,696,756.00	4.36
118	000563	陕国投 A	2,647,463.00	4.28

119	600657	信达地产	2,639,257.00	4.27
120	603866	桃李面包	2,629,289.55	4.25
121	300474	景嘉微	2,598,651.86	4.20
122	002273	水晶光电	2,588,519.00	4.19
123	000800	一汽解放	2,586,258.00	4.18
124	000090	天健集团	2,541,252.72	4.11
125	002709	天赐材料	2,491,752.00	4.03
126	603000	人民网	2,482,135.00	4.02
127	300394	天孚通信	2,464,184.72	3.99
128	300459	金科文化	2,443,743.00	3.95
129	603707	健友股份	2,438,293.00	3.94
130	603338	浙江鼎力	2,413,577.00	3.90
131	002920	德赛西威	2,406,932.00	3.89
132	300415	伊之密	2,392,952.00	3.87
133	002936	郑州银行	2,361,221.00	3.82
134	601139	深圳燃气	2,339,494.80	3.78
135	600633	浙数文化	2,320,777.00	3.75
136	300737	科顺股份	2,317,687.00	3.75
137	002387	维信诺	2,308,440.00	3.73
138	601958	金钼股份	2,282,804.00	3.69
139	600466	蓝光发展	2,242,135.00	3.63
140	300607	拓斯达	2,176,469.00	3.52
141	601677	明泰铝业	2,157,184.45	3.49
142	000400	许继电气	2,081,076.00	3.37
143	002940	昂利康	2,079,278.00	3.36
144	000850	华茂股份	2,076,487.00	3.36
145	300133	华策影视	2,054,259.00	3.32
146	000059	华锦股份	2,051,435.00	3.32
147	000521	长虹美菱	2,035,929.00	3.29
148	300782	卓胜微	2,031,800.00	3.29
149	000885	城发环境	2,031,670.20	3.29
150	000759	中百集团	1,988,278.00	3.22
151	603129	春风动力	1,969,128.00	3.19
152	600075	新疆天业	1,962,252.44	3.17
153	002315	焦点科技	1,955,108.00	3.16

154	002818	富森美	1,886,528.30	3.05
155	603228	景旺电子	1,864,507.60	3.02
156	002891	中宠股份	1,861,171.00	3.01
157	300203	聚光科技	1,859,056.00	3.01
158	603416	信捷电气	1,803,713.00	2.92
159	603939	益丰药房	1,793,135.60	2.90
160	600022	山东钢铁	1,792,187.00	2.90
161	300166	东方国信	1,768,020.00	2.86
162	600291	西水股份	1,760,764.00	2.85
163	002768	国恩股份	1,750,763.00	2.83
164	300037	新宙邦	1,743,920.00	2.82
165	002621	美吉姆	1,718,891.00	2.78
166	600908	无锡银行	1,698,836.00	2.75
167	002583	海能达	1,663,632.00	2.69
168	600486	扬农化工	1,661,153.00	2.69
169	603568	伟明环保	1,645,212.06	2.66
170	603605	珀莱雅	1,621,902.00	2.62
171	002439	启明星辰	1,619,584.72	2.62
172	002585	双星新材	1,610,004.00	2.60
173	600782	新钢股份	1,608,578.48	2.60
174	603027	千禾味业	1,578,532.00	2.55
175	603127	昭衍新药	1,561,747.00	2.53
176	603638	艾迪精密	1,529,156.00	2.47
177	600583	海油工程	1,509,539.00	2.44
178	002266	浙富控股	1,473,925.00	2.38
179	002242	九阳股份	1,418,541.84	2.29
180	300206	理邦仪器	1,369,375.00	2.22
181	300687	赛意信息	1,366,731.00	2.21
182	600754	锦江酒店	1,362,191.00	2.20
183	002697	红旗连锁	1,339,328.10	2.17
184	002544	杰赛科技	1,329,230.00	2.15
185	600017	日照港	1,323,495.00	2.14
186	002100	天康生物	1,313,993.00	2.13
187	603960	克来机电	1,284,818.03	2.08
188	603238	诺邦股份	1,282,928.00	2.08

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

## 2、累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601003	柳钢股份	7,865,445.28	12.72
2	601717	郑煤机	7,004,862.99	11.33
3	601816	京沪高铁	6,301,076.50	10.19
4	300244	迪安诊断	6,158,645.34	9.96
5	002465	海格通信	6,041,131.00	9.77
6	600862	中航高科	6,020,945.00	9.74
7	002127	南极电商	6,010,521.06	9.72
8	600339	中油工程	5,560,759.53	9.00
9	002233	塔牌集团	5,292,854.11	8.56
10	600060	海信视像	5,196,537.00	8.41
11	300033	同花顺	5,196,410.87	8.41
12	600266	城建发展	5,116,839.60	8.28
13	603806	福斯特	5,028,523.30	8.13
14	603233	大参林	5,013,576.98	8.11
15	300558	贝达药业	4,936,590.00	7.99
16	002709	天赐材料	4,777,741.44	7.73
17	002821	凯莱英	4,765,895.00	7.71
18	300012	华测检测	4,728,864.50	7.65
19	600143	金发科技	4,618,718.00	7.47
20	002507	涪陵榨菜	4,434,479.57	7.17
21	300459	金科文化	4,333,590.00	7.01
22	600298	安琪酵母	4,326,187.00	7.00
23	600039	四川路桥	4,189,314.00	6.78
24	300124	汇川技术	4,154,489.44	6.72
25	000090	天健集团	4,153,189.10	6.72
26	603606	东方电缆	3,951,107.00	6.39
27	002831	裕同科技	3,892,374.68	6.30
28	600166	福田汽车	3,823,344.00	6.19
29	300207	欣旺达	3,760,093.00	6.08
30	002156	通富微电	3,729,194.23	6.03
31	002555	三七互娱	3,658,720.00	5.92
32	002056	横店东磁	3,656,635.00	5.92

33	002440	闰土股份	3,615,050.00	5.85
34	600757	长江传媒	3,583,306.84	5.80
35	600026	中远海能	3,573,242.00	5.78
36	002138	顺络电子	3,454,485.00	5.59
37	002640	跨境通	3,368,740.00	5.45
38	601333	广深铁路	3,358,341.97	5.43
39	000563	陕国投 A	3,250,591.90	5.26
40	300418	昆仑万维	3,226,568.96	5.22
41	603566	普莱柯	3,194,962.24	5.17
42	002511	中顺洁柔	3,190,081.60	5.16
43	002807	江阴银行	3,189,039.81	5.16
44	002653	海思科	3,182,231.00	5.15
45	000690	宝新能源	3,147,460.00	5.09
46	000975	银泰黄金	3,130,485.80	5.06
47	300315	掌趣科技	3,130,248.00	5.06
48	002818	富森美	3,102,599.50	5.02
49	600845	宝信软件	3,088,905.00	5.00
50	600716	凤凰股份	3,080,154.36	4.98
51	002139	拓邦股份	3,079,956.00	4.98
52	601678	滨化股份	3,057,481.00	4.95
53	600053	九鼎投资	3,054,609.00	4.94
54	000863	三湘印象	3,051,732.42	4.94
55	601958	金钼股份	3,022,922.00	4.89
56	002867	周大生	3,000,203.00	4.85
57	600649	城投控股	2,998,414.00	4.85
58	600064	南京高科	2,997,298.00	4.85
59	002624	完美世界	2,956,147.00	4.78
60	600643	爱建集团	2,946,091.00	4.77
61	600633	浙数文化	2,941,045.00	4.76
62	300119	瑞普生物	2,923,121.00	4.73
63	603218	日月股份	2,919,676.00	4.72
64	002635	安洁科技	2,875,497.00	4.65
65	600466	蓝光发展	2,860,238.98	4.63
66	600486	扬农化工	2,854,388.00	4.62
67	002155	湖南黄金	2,842,291.00	4.60
68	601799	星宇股份	2,841,545.00	4.60
69	002028	思源电气	2,837,221.00	4.59



70	603338	浙江鼎力	2,813,589.63	4.55
71	002414	高德红外	2,798,397.40	4.53
72	600694	大商股份	2,784,969.36	4.51
73	002901	大博医疗	2,780,217.00	4.50
74	000739	普洛药业	2,764,982.83	4.47
75	002583	海能达	2,714,431.00	4.39
76	300630	普利制药	2,708,026.40	4.38
77	002214	大立科技	2,687,134.00	4.35
78	000800	一汽解放	2,686,070.74	4.35
79	600908	无锡银行	2,666,396.54	4.31
80	603712	七一二	2,647,680.00	4.28
81	601139	深圳燃气	2,646,641.40	4.28
82	002595	豪迈科技	2,584,605.98	4.18
83	002439	启明星辰	2,581,029.26	4.18
84	300482	万孚生物	2,574,312.47	4.16
85	002387	维信诺	2,569,126.00	4.16
86	002273	水晶光电	2,568,547.04	4.16
87	300474	景嘉微	2,544,975.40	4.12
88	300394	天孚通信	2,522,529.00	4.08
89	002878	元隆雅图	2,513,610.26	4.07
90	600380	健康元	2,468,180.00	3.99
91	603486	科沃斯	2,453,518.00	3.97
92	000807	云铝股份	2,437,194.52	3.94
93	603000	人民网	2,402,254.00	3.89
94	300133	华策影视	2,384,801.18	3.86
95	603707	健友股份	2,335,940.00	3.78
96	000400	许继电气	2,315,550.00	3.75
97	002936	郑州银行	2,301,326.00	3.72
98	300607	拓斯达	2,295,151.40	3.71
99	603568	伟明环保	2,268,729.30	3.67
100	000850	华茂股份	2,249,288.00	3.64
101	002174	游族网络	2,154,318.80	3.49
102	002128	露天煤业	2,137,045.12	3.46
103	000521	长虹美菱	2,111,753.00	3.42
104	600291	西水股份	2,103,490.00	3.40
105	000543	皖能电力	2,078,966.12	3.36
106	300737	科顺股份	2,073,434.00	3.35

107	603416	信捷电气	2,062,127.00	3.34
108	000059	华锦股份	2,058,353.00	3.33
109	600075	新疆天业	2,023,886.00	3.27
110	002244	滨江集团	2,016,353.00	3.26
111	601966	玲珑轮胎	2,007,204.00	3.25
112	600782	新钢股份	1,966,973.25	3.18
113	603129	春风动力	1,965,844.00	3.18
114	002315	焦点科技	1,945,046.00	3.15
115	000885	城发环境	1,937,012.70	3.13
116	300166	东方国信	1,915,272.00	3.10
117	603228	景旺电子	1,907,804.60	3.09
118	603939	益丰药房	1,877,853.00	3.04
119	300203	聚光科技	1,871,834.00	3.03
120	600022	山东钢铁	1,862,452.00	3.01
121	002940	昂利康	1,849,335.00	2.99
122	002891	中宠股份	1,841,088.00	2.98
123	002768	国恩股份	1,828,019.00	2.96
124	300206	理邦仪器	1,729,937.00	2.80
125	300037	新宙邦	1,706,108.00	2.76
126	300502	新易盛	1,692,678.60	2.74
127	300285	国瓷材料	1,667,754.00	2.70
128	603127	昭衍新药	1,612,216.20	2.61
129	002100	天康生物	1,603,607.00	2.59
130	002049	紫光国微	1,600,444.00	2.59
131	600754	锦江酒店	1,599,510.00	2.59
132	603027	千禾味业	1,578,627.00	2.55
133	002585	双星新材	1,573,388.00	2.55
134	002258	利尔化学	1,551,640.00	2.51
135	300253	卫宁健康	1,548,364.00	2.50
136	603605	珀莱雅	1,544,458.00	2.50
137	000937	冀中能源	1,536,283.10	2.49
138	603638	艾迪精密	1,535,521.00	2.48
139	002463	沪电股份	1,528,605.00	2.47
140	002242	九阳股份	1,490,817.00	2.41
141	600195	中牧股份	1,468,714.00	2.38
142	603960	克来机电	1,468,435.92	2.38
143	601615	明阳智能	1,458,149.00	2.36

144	600583	海油工程	1,430,082.00	2.31
145	002372	伟星新材	1,429,760.26	2.31
146	002266	浙富控股	1,400,191.76	2.27
147	002013	中航机电	1,399,260.00	2.26
148	300014	亿纬锂能	1,397,487.40	2.26
149	000581	威孚高科	1,392,661.00	2.25
150	300687	赛意信息	1,380,677.91	2.23
151	002475	立讯精密	1,369,310.00	2.22
152	300251	光线传媒	1,337,016.00	2.16
153	600779	水井坊	1,318,361.00	2.13
154	603238	诺邦股份	1,316,237.00	2.13
155	002382	蓝帆医疗	1,312,654.00	2.12
156	002191	劲嘉股份	1,306,895.00	2.11
157	300115	长盈精密	1,306,616.00	2.11
158	000547	航天发展	1,306,397.00	2.11
159	603345	安井食品	1,304,641.00	2.11
160	600967	内蒙一机	1,301,318.00	2.11
161	300529	健帆生物	1,285,138.30	2.08
162	002048	宁波华翔	1,283,728.00	2.08
163	600557	康缘药业	1,272,724.68	2.06
164	002544	杰赛科技	1,258,392.00	2.04
165	600017	日照港	1,249,682.38	2.02

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	697,788,155.26
卖出股票收入（成交）总额	595,075,208.88

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### （五）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

**(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**(十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**2、本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**(十一) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**1、本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**3、本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**(十二) 投资组合报告附注**

**1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

## 2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

## 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	73,810.09
2	应收证券清算款	321,529.08
3	应收股利	-
4	应收利息	1,963.92
5	应收申购款	178,976.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	576,279.13

## 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### （1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

### （2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资股票中不存在流通受限情况。

## 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

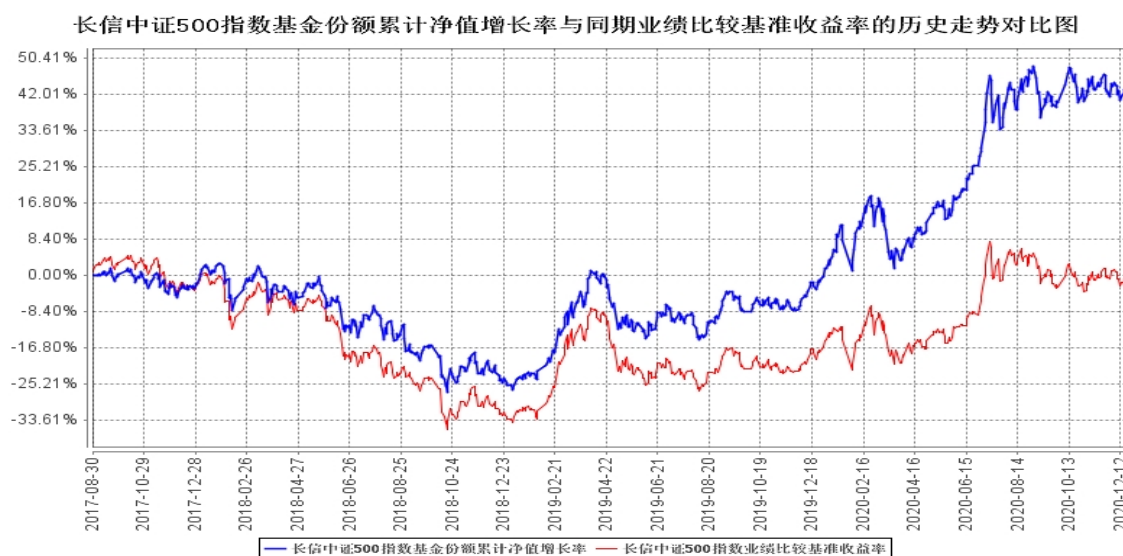
## 十、基金的业绩

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

### (一) 2020年及各历史期间基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年8月30日至2017年12月31日	-1.89%	0.80%	-2.31%	0.86%	0.42%	-0.06%
2018年	-24.06%	1.43%	-31.85%	1.43%	7.79%	0.00%
2019年	33.85%	1.28%	25.09%	1.39%	8.76%	-0.11%
2020年	46.62%	1.51%	19.94%	1.54%	26.68%	-0.03%

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



注：1、图示日期为2017年8月30日至2020年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

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

### （三）投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

#### 1、资产配置策略

本基金为股票指数增强型证券投资基金，投资股票的资产不低于基金资产的



80%，其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。大类资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。

## 2、股票投资策略

本基金作为股票指数增强型证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资主要策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。

### （1）标的指数投资策略

指数化被动投资策略参照标的指数的成分股、备选成分股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

### （2）量化增强策略

量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。

**多因子超额收益模型：**本模型是基于市场不完全有效的假设，着眼于运用统计方法和金融理论发现证券预期收益的驱动因子以及他们之间的关系，利用历史数据回测和构建量化投资模型，预测并持有概率统计上有极大可能产生正收益的投资组合。预期收益的驱动因子可以和基本面投资相同或类似，例如市盈率，资本市值，公司所处板块以及证券历史表现等，也可以是动量因子等技术面指标或者交易数量等流动性因子。

**风险模型：**该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括基金规模、资产波动率、行业集中度等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内，使其收益需要符合指数收益特征。本模型主要通过控制和优化投资组合相对指数在一

些风险因子上的偏离度来实现，常见风险因子如行业因子和基本面因子等。通过调整风险模型，本模型力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不得超过 7.75%。

**成本模型** 该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本，调整基金的换手率，来达到优化投资组合的目的。

### （3）模型的应用与调整

在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。

### （4）存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 3、债券投资策略

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

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

## 4、金融衍生工具投资策略

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

## 6、权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资。

本基金将通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对冲和套利等。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%;

(9) 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%;

(10) 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;

(11) 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;

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

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

(14) 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 95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等; 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%; 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;

(15) 本基金投资流通受限证券时, 遵照相关规定执行;

(16) 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本款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 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;

(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放

期的定期开放基金) 持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%, 但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制;

(19) 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, 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定;

(20) 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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 除上述第 (2)、(10)、(16)、(17) 项外, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时, 从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (5) 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;
- (6) 法律、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, 应当符合本基金的投资目标和投资策略, 遵循持有



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。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

#### （五）标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为：中证 500 指数

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

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

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

#### （六）风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

#### （七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金财产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

3、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；

4、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

(八) 侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。



## 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有价证券、银行存款本息和基金应收的款项以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （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。

## 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/期货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、存托凭证、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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、处于未上市期间的权益类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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

#### 3、流通受限股票的估值

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、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），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

#### 4、交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

（2）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定

的除外)，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值；如成本能够近似体现公允价值，按成本估值。基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 5、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，选取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；

(2) 银行间市场上含权的固定收益品种，选取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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（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；

(3) 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。

6、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。

7、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。

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

9、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。

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

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

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

#### （四）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类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，视为该类基金份额净值错误。

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、或投资人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。

(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。如果基金管理人委托的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

## 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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告；

(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。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

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

(八) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

(九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金

资产估值错误处理;

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。



## 十四、基金费用与税收

### （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、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后的指数使用许可费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易或结算费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、账户开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 3、销售服务费用

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 4、《基金合同》生效后的指数使用许可费

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

指数使用许可费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数使

用许可费每日计提，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

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

上述“（一）基金费用的种类”中第 5—11 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）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### （六）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

---

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在指定媒介公告。

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

### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

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



## 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》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时, 本基金从其最新规定。

### (二) 信息披露义务人

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

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

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

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息, 不得有下列行为:

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

### 1、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

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

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

基金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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。

基金终止运作的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

（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。

### 2、基金份额发售公告

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

### 3、《基金合同》生效公告

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

### 4、基金净值信息

《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

当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的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，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额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，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

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

6、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（含资产组合季度报告）

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，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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。

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基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (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) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长；
- (9) 基金管理人高级管理人员、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；
- (11) 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；
- (12) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (13) 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；
- (14) 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，中国证监会另有规定的情形除外；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提

标准、计提方式和费率发生变更；

- (17) 某一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 更换基金登记机构；
- (20) 本基金开始办理申购、赎回；
- (21) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (22) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (24) 本基金调整份额类别设置；
- (25) 本基金推出新业务或服务；
- (26) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- (27) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 8、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。

#### 9、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。

#### 10、基金投资股指期货的信息披露

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。

#### 11、基金投资资产支持证券信息披露

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。

#### 12、基金投资权证的信息披露

基金管理人将严格按照《信息披露办法》及相关法律、法规和中国证监会的有关规定，将权证投资有关信息在基金定期报告和开放式基金的招募说明书（更新）中披露。基金管理人将在基金季度报告、中期报告、年度报告的投资组合报告中披露基金投资权证的有关信息。

#### 13、基金投资流通受限证券的信息披露

基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### 14、清算报告

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

#### 15、实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

#### 16、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。

基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类基金份额净值、各类基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报



告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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公司住所，以供社会公众查阅、复制。

#### （八）暂停或延迟信息披露的情形

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、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、出现《基金合同》约定的暂停估值的情形时；

4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。



## 十八、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

特定资产包括：（1）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的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### （二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### 1、基金份额的申购与赎回

##### （1）侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

##### （2）主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

（3）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

## 2、基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金登记机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

## 3、基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

基金管理人、相关服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

## 4、基金的估值

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人将对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

## 5、基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

基金管理人可以待侧袋账户资产变现后将与处置侧袋账户资产相关的费用

从侧袋账户中列支。

#### 6、基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

#### 7、基金的信息披露

##### (1) 基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### (2) 定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- 1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- 2) 侧袋账户的初始资产、初始负债；
- 3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- 4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- 5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；
- 6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

##### (3) 临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按规定及时发布临时公告。

## 8、特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户对应的基金份额持有人支付已变现部分对应款项。

## 9、侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

（三）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。

## 十九、风险揭示

### （一）本基金特有的风险

#### 1、标的指数收益率与股票市场平均收益率偏离的风险

本基金的标的指数为中证 500 指数，该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况，但并不能完全代表整个股票市场。所以，标的指数的收益率与整个股票市场的平均收益率可能存在偏离。

#### 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，从而可能使得基金收益水平发生变化，产生风险。

#### 3、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

3) 由于标的指数成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差；

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

5) 由于基金为应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费、基金托管费、销售服务费和指数许可使用费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变

动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### 4、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得稳定适度的超额收益，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股、以及投资股指期货进行套期保值等。这种基于对宏观面、基本面的深度研究、通过基金管理人开发的选股模型做出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

#### 5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 6、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) 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款项，由此基金管理人可能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。

#### 7、成份股退市的风险

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

#### 8、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，如更换基金标的指



数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，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。

#### 9、标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更业绩比较基准的标的指数的情形时，本基金将变更标的指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 10、资产支持证券的投资风险

资产支持证券在国内市场尚处发展初期，具有低流动性、高收益的特征，并存在一定的投资风险。资产支持证券的投资与基础资产密切相关，因此会受到特定原始权益人破产风险及现金流预测风险等的影响；当本基金投资的资产支持证券信用评级发生变化时，本基金将需要面对临时调整持仓的风险；此外当资产支持证券相关的发行人、管理人、托管人等出现违规违约时，本基金将会面临无法收取投资收益甚至损失本金的风险。

#### 11、股指期货的投资风险

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

#### 12、权证的投资风险

本基金可投资权证，权证具有高杠杆、高风险、高收益的特征。除了一般意义上的市场风险外，权证还具有以下投资风险：标的证券价格风险、流动性风险、时效性风险、履约风险等。



### 13、流通受限证券投资风险

本基金的一部分资产将可能投资于流通受限证券。流通受限证券包括非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，所包括的风险主要有由锁定期导致的流动性风险，以及由估值方法的原因导致的本基金的基金净值偏离所持有股票的收盘价所对应的净值等风险。

### 14、存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### （二）投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

##### 1、市场风险

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

###### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

###### （2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于上市公司的股票和债券，其收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

###### （3）利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同

时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。

#### （4）通货膨胀风险

基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### （5）汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致本基金所投资的公司业绩及其证券价格受到影响。

#### （6）上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

#### （7）债券收益率曲线变动的风险

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

#### （8）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### 2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### 3、流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资人大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

本基金拟投资市场、行业及资产具有较好的流动性，与基金合同约定的申购赎回安排相匹配，能够支持不同市场情形下投资者的赎回要求。本基金主要的流动性风险为投资者可能会面临因巨额赎回带来的流动性风险。若是由于投资者大

量赎回而导致基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，在巨额赎回发生时采取备用的流动性风险管理应对措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金申购赎回的具体安排可见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节。

#### （2）拟投资市场的流动性风险评估

本基金主要投资于国内具有良好流动性的金融工具。随着我国股票和债券市场交易机制的逐步完善、投资者结构的优化、信息披露相关法律法规的推出，我国的股票和债券市场已经具备较好的流动性。同时，基金管理人在个股个券选择时将精选具有良好流动性的优质标的。因此，本基金拟投资的市场整体具有较高的流动性水平，可以匹配本基金约定的申购赎回安排。

#### （3）巨额赎回下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金经理和风险管理部会根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以支付所有的赎回款项。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人会在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。具体措施详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节中“（十）巨额赎回的情形及处理方式”的相关规定。

#### （4）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

1) 暂停赎回或延缓支付赎回款项：上述具体措施详见招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节中“（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”及“（十）巨额赎回的情形及处理方式”的相关规定。

2) 延期办理巨额赎回申请：上述具体措施可见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节中“（十）巨额赎回的情形及处理方式”的相关规定。

#### 3) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上

述赎回费全额计入基金财产。

#### 4) 暂停基金估值

暂停估值的情形详见招募说明书“十一、基金资产估值”章节第（六）条的相关约定，若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，实施暂停基金估值，基金管理人相应会采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

#### 5) 实施侧袋机制

具体措施详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

### （三）管理风险

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

### （四）合规性风险

指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

### （五）操作风险

基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

### （六）其他风险

#### 1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。

## 2、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## 3、大额赎回风险

本基金是一开放式基金，基金规模将随着投资人对基金份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售股票和债券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

## 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

## 5、其他不可抗力风险

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，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商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。

### 声明：

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

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，并在履行相关程序后，《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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、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、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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



#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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剩余财产中支付。

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十一、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、《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) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (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任何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、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，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，若委托其他机构办理登记业务的，应对委托的基金登记机构办理基金登记的行为进行监督；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申

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) 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;

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

(15) 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、定期定额投资和非交易过户等的业务规则;

(16) 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、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定, 按有关规定计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 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，但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其

他法律行为；

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(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。

### (三) 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、证券账户及投资所需的其他账户, 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, 因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外;

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金净值信息、基金份额申购、赎回价格;

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册;

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17) 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和



分配；

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高基金销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份



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

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违反法律法规、基金合同以及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、调低基金销售服务费，或调整收费方式、调整基金份额类别的设置；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《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、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、定期定额投资、转托管等业务规则；

（6）推出新业务或服务；

（7）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开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联

系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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 50%（含 50%）；

（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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

### 3、重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第 1 款第（2）项、第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

5、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## （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 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

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 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止《基金合同》、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异议，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按规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

#### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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；



7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的同一类别每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

（十）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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经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、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后

不能低于面值；

- 4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在指定媒介公告。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后的指数使用许可费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易或结算费用；

- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、账户开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 3、销售服务费用

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率

为 0.40%。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 4、《基金合同》生效后的指数使用许可费

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

指数使用许可费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数使用许可费每日计提，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

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

上述“（一）基金费用的种类”中第 5—11 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）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定或相关公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### （六）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

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

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

(11) 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；

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

(14) 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 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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%；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；

(15) 本基金投资流通受限证券时，遵照相关规定执行；

(16) 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本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(17) 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；

(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部



分不受此限制；

(19) 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，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

(20) 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。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第(2)、(10)、(16)、(17)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循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。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货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、存托凭证、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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、处于未上市期间的权益类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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

#### 3、交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值；如成本能够近似体现公允价值，按成本估值。基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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。

#### 4、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，选取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；

(2) 银行间市场上含权的固定收益品种，选取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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（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；

(3) 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。

5、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。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

8、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。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，

按国家最新规定估值。

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

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

#### （四）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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本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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类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，视为该类基金份额净值错误。

本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、或投资人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。

(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。如果基金管理人委托的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

## 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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(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。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

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

(八) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。



### （九）特殊情况的处理

1、基金管理人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，并在履行相关程序后，《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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、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、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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剩余财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算

公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

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

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

《基金合同》受中国（为本合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区）法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：长信基金管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

邮政编码：200120

法定代表人：刘元瑞

成立日期：2003 年 5 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]63 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.65 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

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

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%。其中，投资

于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%;

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

(3) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

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

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

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

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

(10) 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;

(11) 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;

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

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

(14) 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 95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;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%；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；

本基金在开始进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

（15）基金累计投资投入流通受限证券的余额不得超过净值的 5%，投资于单只比例不得超过净值的 3%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整。

（16）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本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（17）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；

（18）本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（19）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，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

（20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

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

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外



的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（10）、（16）、（17）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，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。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第（九）款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

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

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间

债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

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

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行的股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

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

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

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

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

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基

金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应按规定编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

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

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进

行监督和核查。

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

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

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

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

（十一）当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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

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

#### 四、基金财产保管

##### (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。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令, 不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任



公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于本基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金结算备付金账户中，任何人不得动用。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，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》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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

### (三) 基金银行账户的开立和管理

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

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户



办理基金资产的支付。

(四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

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

(五) 债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

(六) 其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由

基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

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

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易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。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2. 估值方法

#### （1）证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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）处于未上市期间的权益类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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

#### （3）交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

- 3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；
- 4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值；如成本能够近似体现公允价值，按成本估值。基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；
- 5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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。

(4) 银行间市场交易的固定收益品种的估值

1) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，选取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；

2) 银行间市场上含权的固定收益品种，选取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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（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；

3) 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。

(5) 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。

(6) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

(8) 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。

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

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

对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

1. 当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为该类基金份额净值错误。基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

(2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新



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

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

3. 由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

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

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

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. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4. 法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### （五）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。

#### （六）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。



### （七）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （八）基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

#### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

#### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

##### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，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。

##### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（九）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

### 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，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。法律法规或监管部门另有规定的除外。

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

### 七、争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

### 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）托管协议的变更程序

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

#### （二）托管协议终止的情形

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

#### （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、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4. 基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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) 将清算结果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。

6. 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剩余财产中支付。

7. 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。

8. 基金财产清算的公告

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

算小组进行公告。

9. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金份额持有人服务

长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”，或“基金管理人”，或“公司”）将为基金份额持有人提供一系列的服务，并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。基金份额持有人可以通过销售网点、客户服务中心、网站等渠道享受全方位、全过程的服务。以下是主要的服务方式和内容：

基金份额持有人服务内容			
序号	类型	明细	内容详述
(一)	账户服务	对账单服务	每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 5 个工作日内，基金管理人根据投资者的对账单定制需求以电子或纸质形式寄送交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。
(二)	查询服务	网络在线查询	客户通过基金账户号码或开户证件号码登录基金管理人网站“账户登录”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改等多项在线服务。
		交易信息查询	在一笔交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“账户登录”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。
		客户账户信息的修改	基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。 为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下： 1、代销客户由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能够修改其中一项关键信息。 2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表；正常变更需要提供身份证复印件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表以及银行柜台的新旧卡转换证明原件，邮寄到本公司。
(三)	基金投资	网上交易	投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站

	的服务		(www.cxfund.com.cn) 享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。
		红利再投资	本基金收益分配时,经投资者选择,基金管理人将为持有人提供红利再投资服务。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时(权益登记日申请设置的分红方式对当次分红无效)选择更改基金分红方式。
(四)	客户服务中心电话服务		客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。 每交易日客户服务中心人工坐席提供服务,投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。
(五)	客户投诉受理服务	客户投诉处理流程	本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理,指定专人负责,设定专门的投诉管理工作流程,并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。
		客户投诉方式	投资者可通过本公司的客户服务专线(400-700-5566)、代销机构、公司网站(www.cxfund.com.cn)、电子邮件(service@cxfund.com.cn)、信件、传真(021-61009865)、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档,通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档,本公司将采取适当措施,及时妥善处理客户投诉,总结相关问题,完善内控制度。
(六)	增值服务	信息定制服务	基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息,包括产品净值、交易确认、公司新闻、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求,将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息。
		个性化理财服务	随着公司的发展,本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务,如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。
		组织投资者交流会	本公司将不定期地举行投资者交流会,为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座,使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外,本公司基金经理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流,让基金份额持有人了解更多基金运作情况。
(七)	投资者教育服务		为了进一步做好投资者服务,让投资者了解证券市场和各类证券投资品种的特点和风险,熟悉证券市场的法律法规,树立正确的投资理念,增强风险防范意识,依法维护自身合法权益,本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。
(八)	公开信息披露服务	披露公司信息	为方便社会公众了解公司的信息,包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息,本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566 (免长话费) 和公司网站



			(www.cxfund.com.cn), 以方便投资者查询。
		披露基金信息	<p>本公司将按规定在中国证监会指定的信息披露媒介上披露法定的文件、公告信息。</p> <p>本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金宣传资料来披露本基金相关信息, 包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。</p> <p>本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构等途径来告知认购、申购、赎回的手续、流程、费用和其他注意事项, 基金投资者可以通过登陆公司网站下载相关表格。</p>
		其他信息的披露	本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外, 还提供其他信息咨询, 包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。
(九)	客户服务 联络 方式	客户服务 专线	4007005566 (免长话费)、工作时间 (8:30-12:00 13:00-17:00) 内可转人工坐席。
		传真	021-61009865
		公司网址	<a href="https://www.cxfund.com.cn/">https://www.cxfund.com.cn/</a>
		电子信箱	service@cxfund.com.cn

## 二十四、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/9/26
2	长信中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/9/30
3	长信基金管理有限责任公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/10/27
4	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/10/28
5	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/10/28
6	长信基金管理有限责任公司关于大泰金石基金销售有限公司投资者办理份额转托管的提示性公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/4
7	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下 48 只公开募集证券投资基金相关法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/30
8	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下 48 只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/30
9	长信中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/30
10	长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/30
11	长信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/11/30
12	长信基金管理有限责任公司关于泰诚财富基金销售（大连）有限公司投资者办理份额转托管的提示性公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/12/16

13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020/12/29
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/1/14
15	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/1/22
16	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/1/22
17	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/1/26
18	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/3/16
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/3/26
20	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/3/30
21	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/3/30
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021/3/31
<b>本信息披露事项截止时间为 2021 年 3 月 31 日</b>			

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

本基金备查文件包括：

- （一）中国证监会注册长信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- （二）《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- （四）法律意见书；
- （五）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

二〇二一年十月二十六日