

南华基金管理有限公司

南华中证杭州湾区交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金

招募说明书（更新）

2022 年第 2 号

基金管理人：南华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

二零二二年二月

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2019 年 7 月 22 日证监许可【2019】1333 号文注册募集。

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申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

本基金的标的指数为中证杭州湾区指数。指数编制方案简介如下：

### 1、样本空间

同中证全指指数的样本空间

### 2、选样方法

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

(2) 在剩余证券中，选取注册地址在杭州、宁波、嘉兴、绍兴、湖州、舟山、金华、上海浦东、上海金山以及上海奉贤等城市和地区的上市公司证券；

(3) 对于注册地址在上海浦东、上海金山以及上海奉贤的上市公司证券，按照中证行业分类，剔除银行、保险、资本市场以及其他金融等行业上市公司证券；

(4) 剔除最近一期半年报、年报净利润为负的上市公司证券；

(5) 计算剩余样本的综合得分，具体计算公式如下：

综合得分 =  $\sum$  各指标降序排名  $\times$  指标对应权重

其中，式中所采用的指标（若财务数据未满三年，采用已有年份数据）及其对应的权重分别为：

- 过去三年 ROE 均值：35%
- 过去三年销售收入增长率：35%
- 过去一年日均总市值：30%

(6) 将上述待选样本的综合得分由低到高排名，选取排名靠前的 100 只上市公司证券作为指数样本。

标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：

<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/931033>。

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，同时投资者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，本基金投资运作过程中面临的主要风险包括：投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、特有风险、流动性风险以及其他风险。

本基金为南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“南华中证杭州湾区 ETF”或“目标 ETF”）的联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金与南华中证杭州湾区 ETF 在投资方法、交易方式、申购赎回方式和业绩表现等方面存在着联系和区别。本基金对南华中证杭州湾区 ETF 的投资比例不低于本基金资产净值的 90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。

本基金为指数基金的联接基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

投资有风险，投资人拟认购（或申购）基金时应认真阅读本基金招募说明书、《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。此外，本基金以 1.00 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1.00 元初始面值的风险，本基金投资者有可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的目标客户不包括特定的机构投资者。

本基金本次更新招募说明书主要对“第三部分 基金管理人”中基金经理等相关信息进行更新，相关信息更新截止日为 2022 年 2 月 11 日，具体内容请见招募说明书正文“第三部分 基金管理人”中“主要人员情况”。除另有说明外，本招募说明书所载内容截止日为 2021

年 3 月 15 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2020 年 12 月 31 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 目 录

第一部分 绪言.....	14
第二部分 释义.....	2
第三部分 基金管理人.....	77
第四部分 基金托管人.....	164
第五部分 相关服务机构.....	242
第六部分 基金的募集.....	393
第七部分 基金合同的生效.....	404
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	414
第九部分 基金的投资.....	525
第十部分 基金的财产.....	626
第十一部分 基金资产估值.....	666
第十二部分 基金的收益与分配.....	727
第十三部分 基金的费用与税收.....	747
第十四部分 基金的会计与审计.....	767
第十五部分 基金的信息披露.....	777
第十六部分 风险揭示.....	848
第十七部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	929
第十八部分 基金合同的内容摘要.....	949
第十九部分 基金托管协议的内容摘要.....	949
第二十部分 基金份额持有人服务.....	959
第二十一部分 其他应披露事项.....	969
第二十二部分 招募说明书存放及其查阅方式.....	989
第二十三部分 备查文件.....	999
附件一 基金合同内容摘要.....	1004
附件二 基金托管协议内容摘要.....	1164

## 第一部分 绪言

《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关规定以及《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由南华基金管理有限公司解释。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，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

《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：指南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金
- 2、基金管理人：指南华基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金产品资料概要：指《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告》
- 9、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
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《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
- 13、《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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

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/或中国银行保险监督管理委员会

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《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

23、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

24、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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指南华基金管理有限公司以及符合《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协议，办理基金销售业务的机构

26、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为南华基金管理有限公司或接受南华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、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



29、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、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、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

31、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

32、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

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、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

36、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

37、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

38、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

39、《业务规则》：指《南华基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》，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 and 投资人共同遵守

40、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

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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%

47、元：指人民币元

48、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

49、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、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

52、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

53、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的、用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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

54、基金份额的类别：指本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值

55、A 类基金份额：在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C 类基金份额：在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

57、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

58、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称 ETF

59、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证杭州湾区指数及其未来可能发生的变更

60、目标 ETF：指另一经中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称

“ETF”), 该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同, 并且该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似, 本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金选择南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南华中证杭州湾区 ETF”)为目标 ETF

61、ETF 联接基金: 指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF(以下简称“目标 ETF”), 紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化, 采用开放式运作方式的基金, 简称联接基金

62、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

63、摆动定价机制: 指当开放式基金遭遇大额申购赎回时, 通过调整基金份额净值的方式, 将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响, 确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

64、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

65、《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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：南华基金管理有限公司

住所：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 10 层 1002-1003 单元

邮政编码：100033

法定代表人：朱坚

成立日期：2016 年 11 月 17 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]2371 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

联系人：吴海燕

联系电话：4008105599

股权结构：南华期货股份有限公司占公司注册资本的 100%。

存续期间：持续经营

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

叶柯先生：董事长，博士。1992 年参加工作，先后在中国证监会期货监管部、中国证监会稽查二局、中国证监会期货监管二部和南华期货股份有限公司工作。2016 年 12 月加入南华基金管理有限公司。

朱坚先生：董事，硕士。1993 年 7 月至 1996 年 7 月先后任职于浙江新华期货经纪有限公司、浙江远通期货经纪有限公司、浙江汇诚期货经纪有限公司；1996 年 7 月至 2002 年 6 月任浙江金迪期货经纪有限公司营业部经理；2002 年 6 月至 2004 年 11 月任浙江新华期货经纪有限公司总经理助理；2004 年 11 月至 2008 年 7 月在南华期货股份有限公司从事业务管理工作，自 2008 年 7 月起任南华期货股份有限公司总经理助理。2018 年 8 月加入南华基

金管理有限公司，现任南华基金管理有限公司总经理。

马易升先生：董事，博士。2010年参加工作，任职于横店集团控股有限公司，担任企业运营分析部部长。

陈松男先生：独立董事，博士。1978年参加工作，先后就职于马里兰大学、台湾政治大学，上海交通大学高级金融学院。历任马里兰大学教授、台湾政治大学教授兼系主任、上海交通大学高级金融学院教授。

王艳涛先生：独立董事，法学学士。1998年参加工作，先后在北京市嘉和律师事务所、国浩律师集团（北京）事务所、北京市海铭律师事务所、北京市荣诚律师事务所工作。历任北京市嘉和律师事务所律师、国浩律师集团（北京）事务所律师、北京市海铭律师事务所合伙人律师、北京市荣诚律师事务所工作主任律师。

朱国华先生：独立董事，硕士研究生。1983年参加工作，任职于上海财经大学。曾兼任上海金鹏期货经纪公司董事长、总经理。现任上海财经大学教授、博士生导师。

## 2、监事会成员

根据公司《章程》第六十六条规定，公司不设监事会，设一名执行监事，执行监事由职工代表连省担任。

连省先生：执行监事，大专，2000年7月至2005年10月就职于中国工商银行资产托管部，2005年11月至2006年10月就职于申万巴黎基金管理公司基金营运总部担任基金会计，2006年11月至2016年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司运作部从事注册登记。2016年12月加入南华基金管理有限公司。

## 3、高级管理人员

叶柯先生：董事长，简历同上。

朱坚先生：总经理，简历同上。

路秀妍女士：汉语言文学专业，学士学位，现任南华基金管理有限公司督察长。1992年参加工作，先后在北京建行信托投资公司、浙江钱塘航空集团有限公司、信达期货有限公司、南华期货股份有限公司工作。2017年6月29日至2018年12月3日担任南华基金管理有限公司总经理。

王明德先生：硕士，现任南华基金管理有限公司副总经理，1999年至2000年任职于北京中怡康经济咨询有限责任公司，担任研究员。2000年至2002年任职于北京国际信托投资公司，担任研究员。2002年至2011年任职于国都证券有限责任公司，历任研究所副所长、所长。2011年至2015年任职于东兴证券股份有限公司，担任研究所所长。2015年至2017

年任职于泓德基金管理有限公司，担任总经理助理兼投研总监。2017年4月加入南华基金管理有限公司，现任南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年4月10日起任职）、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年4月11日起任职）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理（2021年6月3日起任职）。

曾媛：硕士，现任南华基金管理有限公司副总经理。2003年7月至2006年12月于招商银行深圳上步支行，任客户经理；2007年1月至2010年7月于华泰柏瑞基金管理有限公司，任高级渠道经理。2010年8月至2013年6月于上投摩根基金管理有限公司，任华南区域中心代销总监。2014年1月至2015年6月于圆信永丰基金管理有限公司，任全国渠道总监兼华南区总经理。2015年8月至2019年9月于信达澳银基金管理有限公司，任销售总监。2019年9月加入南华基金管理有限公司。

蔡晓永先生：大专，现任南华基金管理有限公司首席信息官。2006年8月至2019年7月，在南华期货股份有限公司网络工程部工作，2009年7月起先后任该部门副经理、经理职务。2019年8月入职南华基金管理有限公司。

#### 4、基金经理

黄志钢先生：硕士，现任南华基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总经理。2004年7月5日至2005年7月14日在美国未来之路任交易员；2005年7月15日至2006年12月10日任海通期货研究发展部研究员；2006年12月10日至2008年10月21日任国元证券衍生产品部高级经理；2008年10月21日至2015年6月5日任国联安基金量化投资部基金经理；2015年6月8日至2018年6月30日任金鹰基金指数及量化投资部总经理；2019年1月1日至2019年8月1日任南华期货研究所量化投资总监，2019年8月入职南华基金管理有限公司，现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年1月29日起任职）、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2022年1月29日起任职）。

#### 5、投资决策委员会成员

主席：

朱坚先生：总经理，简历同上。

成员：

王明德先生：副总经理，简历同上。

何林泽先生：硕士，现任南华基金管理有限公司总经理助理兼固定收益投资总监。2011年6月28日至2020年11月9日，先后在兴证证券资产管理有限公司固定收益部担任固定

收益研究员、投资主办和副总经理职务；2020年11月10日至2021年4月14日在建信信托有限责任公司上海证券业务部担任负责人。2021年4月15日入职南华基金管理有限公司，现担任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年4月28日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2021年6月3日起任职）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理（2021年8月17日起任职）、南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理（2021年9月8日起任职）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理（2021年12月29日起任职）。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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，但依法向监

管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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 20 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；

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；

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。

#### 四、基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。



2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

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

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

法律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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

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

(8) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

## 5、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利益；

(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

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

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。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。

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运营成本，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。

### 2、内部控制的主要内容

内部控制的内容包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

#### (1) 控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构和内部控制体系。董事会下设风险控制委员会，负责审查公司监察稽核、风险管理工作情况，负责对公司合规管理制度、风险控制制度的执行情况进行监督，监督公司内部审计制度的实施，对重大关联交易进行审查和评价。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，经理层下设投资决策委员会和风险管理委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议，投资决策委员会是基金的最高投资决策机构。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合

理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事会和中国证监会报告。

## （2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

1) 董事会下属的风险控制委员会和督察长对公司内外部风险进行评估；

2) 公司经理层下设的风险管理委员会负责对公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；

3) 各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

## （3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离等政策、程序或措施。

控制活动体现为：自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度、授权制度、资产分离制度等，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

## （4）信息与沟通

公司建立双向的信息交流途径，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度，建立了清晰的业务报告系统。

## （5）内部监控

内部监控由公司风险控制委员会、督察长、风险管理委员会和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。督察长和监察稽核部门履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

## 3、基金管理人关于内部控制的声明

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

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心

（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## 二、主要人员情况

郑杨，男，1966年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

## 三、基金托管业务经营情况

截止 2020 年 12 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 10550.89 亿元，比去年末增加 75.18%。托管证券投资基金共二百八十五只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞

丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源弘泽债券型发起式证券投资基金、前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券

型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中融睿享 86 个月定期开放债券型基金、南方梦元短债债券型证券投资基金、鹏扬淳开债券型证券投资基金、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、同泰慧择混合型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、嘉实致禄 3 个月定期



开放纯债债券型发起式证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰颐三年定期开放债券型证券投资基金、华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、财通裕惠 63 个月定期开放债券型证券投资基金、南方尊利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏扬淳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业鼎泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、广发恒隆一年持有期混合型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通富泽混合型证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金、南方誉慧一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中欧真益稳健一年持有期混合型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、金信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、博时价值臻选两年持有期灵活配置混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发汇浦三年定期开放债券型证券投资基金、国联安增泰一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资

基金、华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏华锦润 86 个月定期开放债券型证券投资基金、鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、鹏扬淳安 66 个月定期开放债券型证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、上银聚远盈 42 个月定期开放债券型证券投资基金、新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业稳泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业睿进混合型证券投资基金、易方达悦享一年持有期混合型基金、易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、银华汇益一年持有期混合型基金、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、招商添盛 78 个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、创金合信泰博 66 个月定期开放债券型证券投资基金、淳厚安裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得尊泰 86 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得聚禾灵活配置混合型基金、德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、九泰科新优享灵活配置混合型基金、华泰保兴久盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金、大成卓享一年持有期混合型基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型基金、广发研究精选股票型证券投资基金、恒生前海恒颐五年定期开放债券型基金、华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型基金、嘉实浦惠 6 个月持有期混合型基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘睿新三个月定期开放混合型基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、兴业研究精选混合型基金、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、中欧价值成长混合型基金、创金合信医药消费股票型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、申万菱信安泰广利 63 个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、兴银汇泽 87 个月定期开放债券型证券投资基金等。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- (1) 《中华人民共和国证券法》；
- (2) 《中华人民共和国证券投资基金法》；
- (3) 《公开募集证券投资基金运作管理办法》；

(4) 《证券投资基金销售管理办法》

(5) 《基金合同》、《基金托管协议》；

(6) 法律、法规、政策的其他规定。

## 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

## 3、监督方法

(1) 资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

(2) 在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

(3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

## 4、监督结果的处理方式

(1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

(2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：南华基金管理有限公司

注册地址：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦10层1002-1003单元

法定代表人：朱坚

全国统一客户服务电话：4008105599

传真：010-58965905

联系人：张艳梅

电话：010-58965981

公司网站：[www.nanhuafunds.com](http://www.nanhuafunds.com)

个人投资者还可通过本公司网上交易系统认购本基金，网上交易系统网址：  
<https://trade.nanhuafunds.com/etrading/>

#### 2、其他销售机构

##### (1) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

##### (2) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层陆家嘴金融服务广场二期11层

法定代表人：张跃伟

联系人：朱睿

电话：021-20691942

传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899

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

(3) 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 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：余强萍

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客户服务电话：95021/400-181-8188

网址：<http://www.1234567.com.cn/>

(4) 申万宏源西部证券有限公司

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

室

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

法定代表人：李琦

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

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

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

(5) 南华期货股份有限公司

注册地址：杭州市西湖大道 193 号二层、三层

办公地址：杭州市西湖大道 193 号二层、三层

法定代表人：罗旭峰

联系人：胡霞

电话：0574-87280438

传真：0574-87973856

客户服务电话：400-8888-910

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

(6) 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：崔真

电话：029-81887063

客户服务电话：95325/400-860-8866

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

(7) 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：杜杰

电话：010-60834768

客户服务电话：95548

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

(8) 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：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：0532-85022026

客户服务电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(9) 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：李琪

电话：021-80365243

客户服务电话：400-990-8826

(10) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层

办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系电话：0755-83331195

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

(11) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座18层

法定代表人：王常青

联系人：谢欣然

电话：010-86451810

客户服务电话：400-888-8108

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

(12) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-83574507

客户服务电话：4008-888-888 或 95551



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

(13) 湘财证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙永祥

联系人：江恩前

电话：021-38784580

客户服务电话：95351

网址：<http://www.xcsc.com/>

(14) 东方财富证券股份有限公司

住 所：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

(15) 上海联泰基金销售有限公司

住 所：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：中国（上海）长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

电话：021-62680166

客服电话：400-166-6788

公司网址：<http://www.66liantai.com/>

(16) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：张仕钰

电话：021-65370077

客服电话：400-820-5369

公司网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

（17）南京苏宁基金销售有限公司

住 所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1 号苏宁总部

法定代表人：王锋

联系人：冯鹏鹏

电话：025-6696699-882796

客服电话：95177

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

（18）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531；400-888-8588

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

（19）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

电话：021-80358749

客服电话：400-821-5599

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（20）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：周天雪

电话：021-20613999

客服电话：400-700-9665

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

(21) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法人：肖雯

联系人：王宇昕

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

传真：020-89629011

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

(22) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客服电话：400-673-7010

传真：010-65330699

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

(23) 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万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

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

(24) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

电话：010-59336544

传真：010-59336586

客服电话：4008-909-998

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

(25) 扬州国信嘉利基金销售有限公司

公司地址：扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320

法定代表人：刘晓光

联系人：苏曦

联系电话：0514-82099618

客服电话：400-021-6088

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

(26) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

客服电话：400-821-9031

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

(27) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市自由贸易试验区银城中路8号402室

法定代表人：巩巧丽

联系人：秦琼

联系电话：021-80134149

客服电话：400-808-1016

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

(28) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

联系电话：010-62680527

客服电话：400-619-9059

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

(29) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

法定代表人：钟斐斐

联系人：王悦

联系电话：010-61840688

客服电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com>

(30) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客服电话：95318

网址：<http://www.hazq.com/>

(31) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市益田路江苏大厦38-46层

办公地址：中国深圳福田区益田路江苏大厦 A 座 30 楼

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

客户服务电话：95565

网址：<http://www.cmschina.com>

(32) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：赵守良、姜基彬

客户服务电话：95528

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

(33) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：中国大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 202

办公地址：中国大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2F

法定代表人：樊怀东

联系人：于秀

联系电话：0411-39027810

客服电话：4000-899-100

网址：<http://www.yibaijin.com>

(34) 首创证券有限责任公司

住 所：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

联系人：刘宇

电话：010-59366070

客户服务电话：400-620-0620

网址：<http://www.sczq.com.cn/>

(35) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

联系人：王琪

电话：010-66595488

客户服务电话：95566

网址：<https://www.boc.cn/>

(36) 财通证券股份有限公司

住 所：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、  
1701-1716

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、  
1701-1716

法定代表人：陆建强

联系人：陶志华

电话：0571-87789160

客户服务电话：95336

网址：<http://www.ctsec.com/>

(37) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

法定代表人：黄海洲

联系人：华然

联系电话：0755-82564033

客服电话：40018-40028

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

(38) 浙商证券股份有限公司

住 所：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

联系人：张颖超

电话：0571-87001306

客户服务电话：95345

网址：<https://www.stocke.com.cn>

（39）万家财富基金销售（天津）有限公司

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

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：张军

联系人：王茜蕊

电话：010-59013842

客户服务电话：010-59013895

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

（40）中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔5层

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客服电话：95548

网址：<http://www.gzs.com.cn/>

（41）和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

法定代表人：温丽燕

联系人：董亚芳

联系电话：0371-85518396

客服电话：400-055-5671

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

（42）上海陆享基金销售有限公司



注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼

法定代表人：陈志英

客服电话：400-168-1235

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

(43) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：李珍珍

联系电话：0571-88911818

客服电话：952555

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

(44) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东四环中路 39 号华业国际中心 A 座 10 层

法定代表人：张冠宇

联系人：孙书慧

联系电话：010-85932884

客服电话：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com>

(45) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：王军辉

联系人：张喆

联系电话：010-56075718

客服电话：4006-802-123

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

(46) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层  
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层  
法定代表人：李科  
电话：010-85632771  
传真：010-85632773  
联系人：王超  
客服热线：95510  
公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

(47) 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：江苏省南京市鼓楼区绿地紫峰大厦 2005 室  
法定代表人：吴言林  
联系人：张竞妍  
联系电话：025-66046166  
客服电话：025-66046166  
网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(48) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  
办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 楼  
法定代表人：李兴春  
联系人：陈洁  
联系电话：021-50585353  
客服电话：95733  
网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

## 二、登记机构

名称：南华基金管理有限公司

注册地址：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

注册登记业务办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 10 层 1002-1003 单

元

法定代表人：朱坚

全国统一客户服务电话：4008105599

传 真：010-58965908

联系人：王磊

### 三、律师事务所及经办律师

名 称：浙江天册律师事务所

住 所：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座11楼

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座8楼、11楼

负责人：章靖忠

电 话：0571-87901111

传 真：0571-87901501

经办律师：俞晓瑜、刘森

### 四、会计师事务所及经办注册会计师

名 称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住 所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张勇、郭蕙心

联系电话：021-23238888

传 真：021-23238800

联系人：张勇

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2019 年 7 月 22 日证监许可【2019】1333 号文予以注册。

### 二、基金类别

ETF 联接基金

### 三、基金的运作方式

契约型开放式

### 四、基金存续期限

不定期

### 五、基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

### 六、募集情况

本基金自 2020 年 1 月 21 日至 2020 年 4 月 20 日进行发售。募集期间，本基金共募集 216,157,590.79 份基金份额，有效认购户数为 2,149 户。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金合同生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2020 年 4 月 23 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 第八部分 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本招募说明书或其他相关公告中列明的销售机构进行。基金管理人可根据情况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。

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

### 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、深圳证券交易所以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》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2020年5月25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该类基金份额申购、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该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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

#### 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，否则所提交的申购申请不成立。投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。基金份额持有人在规定的时间内递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇证券/期货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他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，则赎回款项划付时间相应顺延。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。

##### 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，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，

并必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的数额限制

1、申购时，投资者通过销售机构网点每笔申购本基金的最低金额为 10 元人民币（含申购费）；通过本基金管理人网上交易系统申购，每个基金账户单笔申购最低金额为 10 元人民币（含申购费）；通过本基金管理人直销中心申购，首次最低申购金额为 5 万元人民币（含申购费），已在直销中心有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购最低金额为 10 元人民币（含申购费）。本基金直销机构单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

投资者将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

2、每次赎回基金份额不得低于 10 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时，赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见本招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请见基金管理人相关公告。

5、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前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产；投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。具体费用安排如下表所示：



基金的申购费率结构

费用种类	A 类基金份额		C 类基金份额
申购费率	M < 100 万	1.20%	0%
	100 万 ≤ M < 300 万	1.00%	
	300 万 ≤ M < 500 万	0.80%	
	M ≥ 500 万	按笔收取, 1,000 元/笔	

注: M 为金额。

## 2、赎回费

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持续持有期少于 7 天的,收取的赎回费将全额计入基金财产;对于持续持有期不少于 7 天,不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减,具体费率如下:

基金的赎回费率结构

费用种类	A 类基金份额		C 类基金份额	
	持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
赎回费率	Y < 7 天	1.50%	Y < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ Y < 1 年	0.50%	7 天 ≤ Y < 30 天	0.50%
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%	Y ≥ 30 天	0%
	Y ≥ 2 年	0%		

注: Y 为持有期限, 1 年指 365 天。

3、赎回费用未计入基金财产的部分用于支付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》的有关规定在规定媒介上公告。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响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

基金申购费率、基金赎回费率和基金销售费率。

#### 七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算；C 类基金份额不收取申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

##### （1）A 类基金份额

如果投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份数的计算方法如下：

当申购费用适用比例费率时：

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

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

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

当申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000.00 / (1 + 1.20\%) = 49407.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000.00 - 49407.11 = 592.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49407.11 / 1.0500 = 47054.39 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47054.39 份基金份额。

##### （2）C 类基金份额

如果投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净

值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 50,000.00 / 1.0500 = 47,619.05 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式：

A 类基金份额和 C 类基金份额赎回费率均随投资者持有基金份额期限的增加而递减。

### (1) A 类基金份额

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日 A 类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；赎回金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 2 个月，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.2500 = 12,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0.50\% = 62.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 62.50 = 12,437.50 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 2 个月，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,437.50 元。

### (2) C 类基金份额

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日 C 类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；赎回金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 2 个月，假设赎回当日 C

类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.2500 = 12,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0\% = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 0 = 12,500.00 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有期限为 2 个月，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500.00 元。

### 3、基金份额净值计算

由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

$$\text{T 日某类基金份额净值} = \text{T 日该类基金资产净值} / \text{T 日该类基金份额余额}$$

基金份额净值单位为元，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 日的两类基金份额净值在当天收市后分别计算，并按照基金合同的规定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

### 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运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 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或者无法办理申购业务。
- 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、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 8、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

9、所投资的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌。

10、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。

11、基金管理人接受某笔或某些申购申请将使基金总规模超过基金管理人设定的基金总规模限制、使单日净申购比例超过上限或该申购申请超过单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

12、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、7、8、9、10、12 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

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、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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

7、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

8、所投资的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌，或延缓支付赎回对价时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，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，且该部分按照赎回申请日的该类基金份额净值为基础

进行计算。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或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

(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 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该类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) 如果本基金发生巨额赎回，在出现单个开放日内单个基金份额持有人的赎回申请超过前一开放日基金总份额的 10%的情形下，本基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理。基金管理人在当日接受赎回份额比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，对于该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并处理，可以根据当时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该类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，具体见相关公告。

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

### 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 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束、基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定在规定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间达到或超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束、基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定在规定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个工作日的各类基金份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

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

## 十三、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。

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。

#### 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。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规定及国家有权机关的要求以及基金登记机构业务规定来处理。

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交易方式进行基金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。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 二、投资范围

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货等）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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （一）资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股，其中投资于目标 ETF 的

比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货等)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,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

## (二) 目标 ETF 投资策略

### 1、投资组合的投资方式

本基金投资目标 ETF 的两种方式如下:

(1) 申购和赎回:目标 ETF 开放申购赎回后,以组合证券进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF;

(2) 二级市场方式:目标 ETF 上市交易后,在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标 ETF。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主,但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下,为了更好地实现本基金的投资目标,减小与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差,也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

### 2、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标 ETF 的时间和方式。

(1) 当净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、目标

ETF 的申购或买入等；

(2) 当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等。

### (三) 成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

### (四) 债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

本基金将通过相对价值分析、基本面研究、估值分析、可转换债券条款分析，选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资。

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

### (五) 资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产等具有稳定现金流的资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

### (六) 金融衍生工具投资策略

#### 1、股指期货投资策略

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

#### 2、国债期货投资策略

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上以套期保值为

目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

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

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；
- (3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (5) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (8) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (10) 本基金参与股指期货交易、国债期货交易后，需遵循下列投资比例限制：
  - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
  - 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值

的 10%；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%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

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

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

(13) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 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、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第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。除上述第（1）、（2）、（7）、（11）、（12）项外的其他比例限制，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或交易停牌或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本基金以中证杭州湾区指数为标的指数。

本基金的业绩比较基准为：中证杭州湾区指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

中证杭州湾区指数由中证指数有限公司发布，旨在反映环杭州湾区域上市公司的整体表现。

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》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，本基金合同终止。

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。

尽管有前述约定，若标的指数变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，而无需召开基金份额持有人大会审议，报中国证监会备案并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

## 七、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资标的指数的指数基金，而无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资人合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；
- 2、目标 ETF 终止上市；
- 3、目标 ETF 基金合同终止；
- 4、目标 ETF 的基金管理人/基金托管人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人/基金托管人相同的除外）；
- 5、目标 ETF 与其他基金进行合并；
- 6、中国证监会规定的其他情形。

若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决，目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会，相应

变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。

#### 八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

#### 八、投资组合报告

本投资组合的报告期为 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止（财务数据未经审计）。

##### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	37,837,800.00	90.22
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	4,038,093.46	9.63
8	其他资产	62,391.97	0.15
9	合计	41,938,285.43	100.00

##### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合



## 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末，本基金未持有境内股票投资组合。

## 2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通股票投资。

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

报告期末，本基金未持有股票。

## (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

## (五) 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

报告期末，本基金未持有债券。

## (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十名资产支持证券投资明

细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## (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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

## (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十名基金投资明细

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	杭州湾区	ETF 基金	契约型开放式	南华基金管理有限公司	37,837,800.00	92.94

## (十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## (十一) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## (十二) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

2、本基金本报告期内不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	53,788.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	694.18
5	应收申购款	7,909.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	62,391.97

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有股票。

## 第十部分 基金的业绩

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

### 一、本报告期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

南华中证杭州湾区 ETF 联接 A 净值表现：

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
2020年4 月23日至 2020年12 月31日	31.73%	1.14%	35.95%	1.26%	-4.22%	-0.12%

南华中证杭州湾区 ETF 联接 C 净值表现：

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
2020年4 月23日至 2020年12 月31日	31.36%	1.14%	35.95%	1.26%	-4.59%	-0.12%

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：

(1) 南华中证杭州湾区 ETF 联接 A 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2020年4月23日至2020年12月31日）

南华中证杭州湾区ETF联接A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



(2)南华中证杭州湾区ETF联接C基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2020年4月23日至2020年12月31日)

南华中证杭州湾区ETF联接C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:

(1) 本基金基金合同生效日为2020年4月23日,截至本报告披露时点,本基金基金合同生效不满1年;

(2) 本基金的建仓期为2020年4月23日至2020年10月22日,建仓期结束时本基金

各项资产配置比例符合基金合同的约定。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 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、期货结算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份额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、基金份额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。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十二部分 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

基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、国债期货合约、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

### 四、估值方法

#### 1、目标 ETF 的估值

本基金持有的目标 ETF 基金份额以其当日基金份额净值估值，若估值日为非证券交易所交易日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。

## 2、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

## 3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

## 4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种



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

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、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

7、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

8、股指期货合约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、国债期货合约以估值日的结算价进行估值。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。

10、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。

11、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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，基金托管人承担复核责任。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。

## 五、估值程序

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

从其规定。

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

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当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对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，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。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或因其他原因致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

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

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类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各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、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同一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；

4、基金收益分配后各类基金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净值减去本类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

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。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、除法律法规、中国证监会另有规定外，从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF基金份额所对应的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 3、基金的销售服务费

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，并由登记机构代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

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



## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

律文件。

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

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

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

## （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。

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

## （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金净值信息

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

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

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

#### (五) 基金份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### (七) 临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书,并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、《基金合同》终止、基金清算;

- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、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；
- 16、任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、本基金变更标的指数；
- 23、本基金变更目标 ETF；
- 24、本基金推出新业务或服务；

25、调整基金份额类别设置；

26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

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。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

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

#### （十一）投资股指期货的信息披露

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

#### （十二）投资国债期货的信息披露

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

#### （十三）投资于资产支持证券的信息披露

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。

#### （十四）对基金估值有重大影响的信息

基金管理人应在中期报告和年度报告中披露估值程序、估值技术及重大变化、假设、输入值、对基金资产净值及当期损益的影响等对基金估值有重大影响的信息。

(十五) 中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

1、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、基金合同约定的暂停估值的情形；
  - 4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。
- 九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。



## 第十七部分 风险揭示

本基金投资运作过程中面临的主要风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、特有风险、流动性风险以及其他风险。

### 1、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等。

#### (1) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于基金股票资产与债券资产市场价格的波动。影响股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素：

##### 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，基金投资于债券与上市公司的股票，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上市公司业绩及其股票价格。

##### 6) 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然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者大额赎回，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。

#### (4) 跟踪误差风险

尽管基金管理人将采取严格的风险控制措施，控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，但是，因法律法规的限制及其它限制，本基金不能投资于部分标的指数成份股；此外，基金运作过程中会产生一些管理成本、交易成本以及其它费用，本基金的每日收益率将不可避免的相对标的指数产生偏离，造成跟踪误差。

### 2、管理风险

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

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

### 3、合规性风险

是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。

#### 4、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、交易错误等风险。

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中,可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

#### 5、其他风险

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

由于投资人密码失密、操作不当、投资决策失误等原因发生的可能损失由投资人自行承担;在投资人进行证券交易中他人做出的保证获利或不会发生亏损的任何承诺都属于无效承诺。

#### 6、本基金特有风险

##### (1) ETF 联接基金的特有风险

本基金为目标 ETF 的联接基金,两者在投资方法、交易方式等方面既有联系又有区别。本基金与其目标 ETF 基金的业绩表现可能出现差异,可能引发差异的因素包括但不限于以下几点:

- 1) 二者的业绩比较基准存在差异。
- 2) 二者的投资组合限制存在差异。
- 3) 联接基金在进行现金与股票转换的过程中的成本与收益受二级市场价格影响。

4) 由于联接基金可通过二级市场在证券交易所买入、卖出目标 ETF 基金份额,因此目标 ETF 二级市场的折溢价将影响联接基金的收益。

5) 联接基金可以直接投资标的指数的成份股及备选成份股,这部分股票投资组合与 ETF 的投资组合可能存在差异。

##### (2) 投资于 ETF 基金的特定风险

##### 1) 目标 ETF 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标 ETF 标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### 2) 目标 ETF 标的指数波动的风险

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

### 3) 目标 ETF 基金投资组合回报与其标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使目标 ETF 基金投资组合的收益率与其标的指数的收益率发生偏离：

a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使目标 ETF 基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

b. 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，使目标 ETF 基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

c. 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致目标 ETF 基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

d. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使目标 ETF 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。

e. 由于目标 ETF 基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使目标 ETF 基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

f. 在目标 ETF 基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对目标 ETF 基金的收益产生影响，从而影响目标 ETF 基金对标的指数的跟踪程度。

g. 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，目标 ETF 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；因指数编制机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

### 4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

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

### 5) 成份股停牌风险

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股，当标的指数成份股停牌时，可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

### 6) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定向中国证监会报告并提出解决方案，并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，本基金合同直接终止。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，基金管理人应依照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 7) 目标 ETF 基金标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，目标 ETF 基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，目标 ETF 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。

#### 8) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管目标 ETF 基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 9) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误。

#### 10) 退市风险

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

#### 11) 投资者申购失败的风险

因目标 ETF 基金在申购、赎回清单可能不会对所有的成份股允许使用现金替代，而且现金替代比例会设置现金替代上限比例进行控制。所以投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法购入申购所需的足够成份股，导致申购失败的风险。

#### 12) 投资者赎回失败的风险

目标 ETF 的基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，

由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

### 13) 基金份额赎回对价的变现风险

目标 ETF 基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

### 14) 第三方机构服务的风险

目标 ETF 基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

c. 证券/期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

### (3) 投资股指期货的风险

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。

### (4) 投资国债期货的风险

本基金可参与国债期货交易，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资者权益遭受较大损失。国债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。

### (5) 投资资产支持证券的风险

资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，本基金将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请投资者关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

## 7、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

## 8、本基金主要的流动性风险及风险管理方法说明

### (1) 基金申购、赎回安排

本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体内容详见本招募说明书第八章。

### (2) 拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于目标ETF（南华中证杭州湾区ETF）基金份额、标的指数成份股、备选成份股，并且投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。目标ETF是南华中证杭州湾区ETF，主要投资于环杭州湾区域中流动性好、盈利能力高且兼具成长性的A股市场股票。因此，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，在正常市场环境下本基金的流动性风险较低。

但在特殊情况下，本基金投资于上述资产时，仍存在以下流动性风险：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将南华中证杭州湾区ETF、股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金被迫以不适当的价格卖出南华中证杭州湾区ETF、股票或债券；三是南华中证杭州湾区ETF暂停赎回或暂停在二级市场交易，导致基金管理人出现现金支付困难，基金管理人因此暂停接受投资者的赎回申请。以上情形均可能给本基金带来不利影响。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

- ①延期办理巨额赎回申请；
- ②延缓支付赎回款项；
- ③暂停接受赎回申请；

④中国证监会认定的其他措施。

(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

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：1) 延期办理巨额赎回申请；2) 暂停接受赎回申请；3) 延缓支付赎回款项；4) 暂停基金估值；5) 摆动定价；6) 中国证监会认定的其他措施。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本基金、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、无法及时获得基金的净值数据和承担较高投资成本等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。



## 第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变

现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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。

6、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财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

## 第二十一部分 基金份额持有人服务

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系本公司客户服务电话。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和销售机构提供。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和有关情况，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、资讯服务

公司为定制资讯服务的投资者，提供电子邮件、短信形式的资讯服务。

投资者可通过拨打公司客户服务电话或登录公司网站在服务定制栏目中定制此项服务。

### 二、线上客户服务

本公司网站设置了线上服务渠道，投资者可以通过电子邮箱开展相关咨询，客服人员在收到邮件咨询后的 24 小时内答复或联系投资者。

客户服务电子邮箱地址为：[services@nanhuafunds.com](mailto:services@nanhuafunds.com)。

### 三、定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的规则请参见相关公告。

### 四、关于网站服务

公司网站为客户提供产品信息查询、产品净值查询、公告信息查询、交易状态查询等内容的服务。

### 五、客户意见、建议或投诉处理

投资者可以通过本公司热线电话、电子邮箱、传真等渠道对基金管理人和销售机构提出意见、建议或投诉。

### 六、联系方式

南华基金管理有限公司

客服电话：4008105599

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

## 第二十二部分 其他应披露事项

本基金招募说明书更新期间，本基金及基金管理人的有关公告如下：

- 1、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告，2020/04/24；
- 2、南华基金管理有限公司关于南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与部分销售机构开展的申购费率优惠及定期定额投资费率优惠活动的公告，2020/05/22；
- 3、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告，2020/05/22；
- 4、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告，2020/06/17；
- 5、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增北京唐鼎耀华基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告，2020/06/18；
- 6、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增北京植信基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告，2020/06/23；
- 7、南华基金管理有限公司旗下公募证券投资基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告，2020/07/21；
- 8、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 2 季度报告，2020/07/21；
- 9、南华基金管理有限公司关于南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与招商证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告，2020/08/06；
- 10、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告，2020/08/13；
- 11、南华基金管理有限公司关于暂停网上交易系统的通知，2020/08/21；
- 12、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金(A 类份额)基金产品资料概要更新，2020/08/26；
- 13、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金(C 类份额)基金产品资

料概要更新，2020/08/26；

14、南华基金管理有限公司旗下公募基金 2020 年中期报告提示性公告，2020/08/28；

15、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年中期报告，2020/08/28；

16、南华基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告，2020/09/16；

17、南华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司费率优惠活动的公告，2020/09/19；

18、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 3 季度报告，2020/10/28；

19、南华基金管理有限公司旗下公募证券投资基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告，2020/10/28；

20、南华基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公示，2021/12/04；

21、关于提醒投资者及时更新已过期身份证明文件、风险承受能力调查问卷、新版营业执照及实际控制人、受益所有人等信息的通知，2021/12/04；

22、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构的公告，2021/12/23；

23、南华基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告，2021/01/15；

24、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 4 季度报告，2021/01/21；

25、南华基金管理有限公司旗下公募证券投资基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告，2021/01/21；

26、南华基金管理有限公司关于变更网上直销交易平台支付渠道的公告，2021/01/29；

27、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与南华期货股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告，2021/01/30；

28、南华基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告，2021/03/11。

## 第二十三部分 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

以上查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所。基金投资者在营业时间可免费查阅，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。

南华基金管理有限公司

二零二二年二月十五日



## 附件一 基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、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、赎回或转换申请；
- (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) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、

非交易过户、转托管、收益分配和定期定额投资等业务规则；

(17) 与基金托管人协商一致，代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利；

(18) 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，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(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 20 年以上；

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

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

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

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

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

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

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

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

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及

国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户和期货结算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、证券账户和期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；向审计、法律等外部专业顾问提供相关基金商业秘密的，应当要求相关外部专业顾问履行相应保密义务；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

(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开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。

### (三) 基金份额持有人的权利和义务

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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
  - (5) 出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
  - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
  - (7) 监督基金管理人的投资运作；
  - (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
  - (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：
- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
  - (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
  - (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
  - (4) 交纳基金认购、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) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实、准确、完整；
  - (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比

例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使目标 ETF 的基金份额持有人大会的表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，由本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

#### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规和中国证监会另有规定的除外：

（1）修改《基金合同》的重要内容或者提前终止《基金合同》，本基金合同对终止《基金合同》另有约定的除外；

（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提高销售服务费，但法律法规或监管部门要求调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标 ETF 基金变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持

有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会；

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式、增加、取消或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) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务规则；

(6) 由于目标 ETF 终止上市或基金合同终止，变更为直接投资该标的指数的指数型基金；

(7) 标的指数更名；

(8) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提



议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次

基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许以及基金合同约定的其他方式召开，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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止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)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

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

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。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。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

### （1）现场开会

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

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

### （2）通讯开会

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

### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

## （八）生效与公告

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

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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人及基金托管人协商一致,履行适当程序并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序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基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止的;
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止,在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3、出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

5、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，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。

6、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财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存20年以上。

#### 四、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，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

#### 五、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

《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。



## 附件二 基金托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人（或简称“管理人”）

住所：浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼

法定代表人：朱坚

成立时间：2016年11月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]2371号

注册资本：2亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

电话：4008105599

#### (二) 基金托管人（或简称“托管人”）

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

成立日期：1992年10月19日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：中国证监会证监基金字[2003]105号

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债

券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货等）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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

（1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不得低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

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

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

3 个月内予以全部卖出；

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

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

(10) 本基金参与股指期货交易、国债期货交易后，需遵循下列投资比例限制：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；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%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

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

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

(13) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 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、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第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。除上述第

(1)、(2)、(7)、(11)、(12) 项外的其他比例限制，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或交易停牌或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需召开基金份额持有人大会审议。

基金托管人对上述指标的监督义务，仅限于监督由基金管理人管理且由托管人托管的全部公募基金是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

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

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

法律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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

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

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，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、法规或《基金合同》有关于基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券清单，加盖公章并书面提交。基金管理人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给基金托管人。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，经基金托管人确认后，新的关联交易名单开始生效。基金托管人仅按基金管理人提供的基金关联方名单为限，进行监督。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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

基金托管人根据基金管理人提供的银行间债券市场交易对手名单进行监督。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手的资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

6、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金银行存款业务进行监督。

基金管理人应当加强对基金投资银行存款风险的评估与研究，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。如果基金托管人在运作过程中遵循有关法律法规的规定和《基金合同》的约定监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。

7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

如下所指“流通受限证券”与本协议以及基金合同所指“流动性受限资产”定义存在不同。就流动性受限资产定义，请参照基金合同的“第二部分：释义”部分。

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。

(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等问题的应对解决措施，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的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出现困难时，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的，基金托管人不承担任何责任。

(3) 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，在中国证监会规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。

有关基金投资的流通受限证券应保证登记存管在相关基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并保证基金托管人能够正常查询。如因流通受限证券的登记存管不能保证基金托管人正常履行资产保管责任，有关此项基金资产存管的责任由基金管理人承担。

如基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求，导致基金出现风险使基金托管人承担连带赔偿责任的，若基金托管人此前已切实履行监督职责的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(4) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于执行投资指令之前两个工作日将有关资料书面提交基金托管人，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批准文件。
- 2) 有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。
- 4) 该基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制

5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法就上述问题达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。基金托管人履行了本协议规定的监督职责后，不承担任何责任。

(5) 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。

8、基金托管人对基金投资中期票据的监督责任仅限于依据本协议相关规定对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。基金因投资中期票据导致的信用风险、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基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人管理的基金在投资中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，基金管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

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

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

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金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的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户以及投资所需其他账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人



限期纠正。

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

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

#### 四、基金财产保管

##### （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、基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（基金托管人主动扣收的汇划费除外）。基金托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。
- 3、基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户、证券账户、期货结算账户以及投资所需其他账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合，但对基金财产的损失不承担责任。

##### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的南华基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人

收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况,并及时将资金到账凭证传真给基金管理人,双方进行账务处理。

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

### (三) 基金资产托管专户的开立和管理

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设资产托管专户,并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求,提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人刻制、保管和使用。

本基金的一切货币收支活动,均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的资产托管专户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要,基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

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

### (四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

基金证券账户的开立和原始开户材料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。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上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户,基金托管人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、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

### (五) 银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后,在符合监管机构要求的情况下,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、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金托管人协助基金管理人完成银行间债券市场准入备案。

#### （六）其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应比照相关规定，就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

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

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

#### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 20 年以上。

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与合同原件核对一致的并加盖基金管理人公章的合同传真件或复印件，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、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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，基金托管人承担复核责任。本基金的基金会计主责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。每个工作日，基金管理人应对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额净值和基金资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人约定对外公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### （二）基金资产估值方法

#### 1、估值对象

基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、国债期货合约、其它投资等资产及负债。

#### 2、估值原则

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

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

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

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

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

### 3、估值方法

#### (1) 目标 ETF 的估值

本基金持有的目标 ETF 基金份额以其当日基金份额净值估值，若估值日为非证券交易所交易日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。

#### (2) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值。

(3) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

3) 在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, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;

4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值。

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

(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) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示, 按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(7) 本基金投资同业存单, 按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 按成本估值。

(8) 股指期货合约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) 国债期货合约以估值日的结算价进行估值。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。

(10) 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。

(11) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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，基金托管人承担复核责任。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。

#### 4、特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法第(10)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及其登记结算机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### (三) 估值错误处理

1、当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误；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；错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；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，基金托管人不承担任何责任。

2、当因基金管理人和基金托管人原因致使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直接损失，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的，在基金份额净值出错且造成基金份额持有人直接损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，对于向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照各自收取的管理费和托管费的比例承担相应的责任。

（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直接损失，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），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、有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，致使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，但是仍未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

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

（四）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、因不可抗力或因其他原因致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；



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

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （五）基金账册的建立

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

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （六）基金定期报告的编制和复核

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

在《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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并公告；在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告并公告；在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告并公告。《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。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 30 日内完成中期报告，在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通

知基金管理人。

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

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

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

在基金托管人编制中期报告和年报前，基金管理人应将每年6月30日、12月31日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

## 七、适用法律及争议解决方式

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

（二）相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，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，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人均具有约束力，仲裁费由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

### （二）基金财产的清算

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

2、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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

#### 5、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，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。

6、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。

#### 7、清算费用

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

#### 8、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。

#### 9、基金财产清算的公告

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

#### 10、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 20 年以上。