

华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基  
金联接基金  
更新的招募说明书  
(2022 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇二二年二月

## 重要提示

本基金于2014年4月2日经中国证券监督管理委员会《证监许可【2014】347号》注册，进行募集。本基金的基金合同自2014年8月12日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金标的指数为德国DAX指数（DAX Index）。

### （1）指数样本空间和成分股选择

达克斯®指数（德国股票指数）追踪了德国股市中市值最大、最重要的公司的表现。该指数包括了在法兰克福证券交易所高级市场交易的40只市值最大、表现最好的公司。

### （2）成分股数量和权重

本指数成份股数量为40，权重根据自由流通股市值决定，单只成分股权重上限为10%。

提示投资者关注，上述关于指数编制方法的介绍系依据指数编制机构由基金管理人翻译而来，可能存在中文翻译无法完全真实反映英文原意的情形，关于指数编制机构关于标的指数编制方法的原文描述请登录<https://qontigo.com/>查询。

本基金为华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，基金净值会因为华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金净值波动等因素产生波动，华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金主要跟踪德国市场的DAX指数，其投资的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金为华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，主要通过投资华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金紧密跟踪标的指数的表现。

华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金初始募集净值1元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。因分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

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

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

本招募说明书中涉及托管业务的相关内容已经本基金托管人复核。本次招募说明书对增设C类基金份额相关内容进行了补充更新，相关信息更新截止日为2022年2月22日。除特别说明外，本招募说明书其他所载内容截止日为2021年10月20日，有关财务数据表现截止日为2020年12月31日，净值表现截止日为2020年6月30日。

## 目录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	12
五、相关服务机构 .....	28
六、基金的募集 .....	51
七、基金合同的生效 .....	52
八、基金份额的申购、赎回与转换 .....	53
九、基金的投资 .....	64
十、基金的业绩 .....	70
十一、基金的财产 .....	76
十二、基金资产的估值 .....	78
十三、基金的收益与分配 .....	86
十四、基金的费用与税收 .....	88
十五、基金的会计与审计 .....	92
十六、基金的信息披露 .....	93
十七、风险揭示 .....	98
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	106
十九、基金合同的内容摘要 .....	109
二十、基金托管协议的内容摘要 .....	110
二十一、对基金投资人的服务 .....	111
二十二、其他应披露事项 .....	113

二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	122
二十四、备查文件 .....	123
附件一：基金合同内容摘要 .....	124
附件二：托管协议内容摘要 .....	143

## 一、绪言

《华安国际龙头（DAX）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“本招募说明书”或“招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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》”）及其他有关规定以及《华安国际龙头（DAX）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。

本更新的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合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

**基金或本基金:** 指华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金;

**目标ETF:** 指另一获中国证监会核准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。本基金选择华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF;

**ETF联接基金:** 指将绝大多数基金财产投资于目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金，简称“联接基金”;

**《基金合同》:** 指《华安国际龙头（DAX）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;

**《托管协议》:** 指《华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效修订和补充;

**《招募说明书》或本招募说明书:** 指《华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新;

**《基金份额发售公告》:** 指《华安国际龙头（DAX）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》;

**《业务规则》:** 指《华安基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守;

**中国:** 指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区);

**中国证监会:** 指中国证券监督管理委员会;

**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;

**外管局:** 指国家外汇管理局;

**《基金法》:** 指《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；

《销售办法》：指《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；

《运作办法》：指《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；

《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日公布、自同年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；

《试行办法》：指中国证监会于2007年6月18日公布、自同年7月5日起实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《通知》：指中国证监会于2007年6月18日公布、自同年7月5日起实施的《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订；

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

《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

元：指人民币元；

基金管理人：指华安基金管理有限公司；

基金托管人：指招商银行股份有限公司；

境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构；

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

注册登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的基金注册登记机构为华



安基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构；

注册登记系统：指华安基金管理有限公司公司开放式基金注册登记系统；

投资者：指个人投资者、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；

个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人；

机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

基金份额持有人：指依《招募说明书》和《基金合同》合法取得基金份额的投资者；

基金募集期：指《基金合同》和《招募说明书》中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；

《基金合同》生效日：指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和《基金合同》规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

存续期：指《基金合同》生效至终止之间的不定期期限；

工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；

巨额赎回：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时的情形；

投资指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

认购：指在基金募集期内，投资者按照《基金合同》和《招募说明书》的规定申请购买本基金基金份额的行为；

发售：指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为；

申购：指在《基金合同》生效后的存续期间，投资者根据《基金合同》和《招募说明书》的规定申请购买本基金基金份额的行为；

赎回：指在《基金合同》生效后的存续期间，基金份额持有人按《基金合同》和《招募说明书》规定的条件要求将本基金份额兑换为现金的行为；

代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；

销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；

基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；

指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊和指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；

基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

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行为；

开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（即上海证券交易所和深圳证券交易所的共同交易日）；

T日：指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；

T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；

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；

基金资产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；

基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值；

基金份额净值：指以基金资产净值除以基金份额余额所得的单位基金份额的价值；

基金资产估值：指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净

值和基金份额净值的过程；

**基金份额分类：** 本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值；

**A类基金份额：** 在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；

**C类基金份额：** 在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额；

**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；

**公司行为信息：** 指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动，及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息，包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息；

**法律法规：** 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

**基金产品资料概要：** 指《华安国际龙头（DAX）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。关于基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行；

**不可抗力：** 指任何不能预见、不能避免并且不能克服，且在《基金合同》由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使《基金合同》当事人无法全部或部分履行《基金合同》的事件和因素。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、成立日期：1998 年 6 月 4 日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：021-38969999
- 11、客户服务电话：4008850099
- 12、联系人：王艳
- 13、网址：www.huaan.com.cn

#### （二）注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5 亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	28%
上海上国投资资产管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	12%

### （三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

#### （1）董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

吴从宏先生，大学学历，公共管理硕士学位。历任上海市国有资产监督管理委员会办公室主任科员、信访办副主任、主任等。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、总裁。

马名驹先生，硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司总经理、副董事长，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司副总裁。现任上海锦江国际投资管理有限公司董事长，Radisson Hospitality AB 董事长，上海锦江资本股份有限公司执行董事、首席执行官，上海锦江资产管理有限公司董事长，锦江国际集团财务有限责任公司董事长，上海齐程网络科技有限公司董事长，长江养老保险股份有限公司董事，史带财产保险股份有限公司监事。

陈志刚先生，本科学历。历任上海市黄浦区人民法院书记员、助理审判员；上海国际信托投资公司金融三部项目经理；上投投资管理有限公司总经理助理、副总经理、总经理；上海国际集团资产管理有限公司监事长；上海华东实业有限公司总经理；上海市再担保有限公司总经理；上海国际集团有限公司风险合规部总经理。现任上海上国投资管理有限公司党支部书记、董事长、法定代表人；兼任申联国际投资有限公司董事、上海证券有限责任公司董事、上海谐意资产管理有限公司监事。

郭传平先生，硕士研究生学历。历任国泰君安证券哈尔滨西大直街营业部副

总经理（主持工作）、总经理（兼齐齐哈尔营业部总经理）、黑龙江营销总部副总经理（主持工作）、总经理、黑龙江分公司总经理、上海市委市政府联席办督查专员助理、国泰君安证券公司业务巡视督导委员会委员、国泰君安期货有限公司党委委员、纪委书记、监事长等职务。现任国泰君安证券公司巡察委员会巡察专员、国泰君安投资管理股份有限公司党委书记、董事长。

**独立董事：**

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

周军先生，硕士研究生学历。曾先后担任湖北省体改委副处长，中国证监会湖北证监局办公室主任，中国证监会江西证监局副局长，中国证监会人事教育部（党委组织部）副主任、副部长、巡视员，中证资信公司筹备组负责人、中国上市公司协会监事长，中清汇银（北京）投资管理有限公司顾问。

严弘先生，博士研究生学历，教授。历任美国得克萨斯大学奥斯汀分校金融学助理教授、美国南卡罗来纳大学达拉莫尔商学院金融学终身教职、美国证券交易委员会及美国联邦储备局访问学者、长江商学院和香港大学客座教授、亚洲金融学会会刊《金融国际评论》主编。现任上海交通大学上海高级金融学院金融学教授、学术副院长，中国私募证券投资研究中心主任和全球商业领袖学者项目（GES）学术主任。

**（2）监事会**

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局（原上海证管办）机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，

华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

### （3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，22 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生，21 年金融、基金行业从业经验。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

翁启森先生，硕士研究生学历，27 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

杨牧云先生，本科学历、硕士，21 年金融法律监管工作经验。历任上海市人民检察院科员，上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

姚国平先生，硕士研究生学历，17 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，22 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

范伟隽先生，硕士研究生学历，21 年金融、基金行业从业经验。历任毕马

威华振会计师事务所项目经理，中国证监会上海监管局主任科员、副处长，富国基金管理有限公司督察长，华安基金管理有限公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司首席信息官。

## 2、本基金基金经理

倪斌先生，硕士研究生，10年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018年9月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）、华安纳斯达克100指数证券投资基金、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2019年6月起，同时担任华安三菱日联日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2020年5月起，同时担任华安法国CAC40交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年1月起，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021年2月起，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

徐宜宜先生，自2014年8月12日至2018年9月28日担任华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

张霄岭先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部高级总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，基金投资部总监，兼任投资研究部联席总监

邹维娜女士，绝对收益投资部高级总监

胡宜斌先生，基金投资部总监



上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 4、业务人员的准备情况：

截至 2021 年 12 月 31 日，公司目前共有员工 416 人（不含子公司），其中 63.2% 具有硕士及以上学历，95.7% 以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

#### （四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购对价、赎回对价；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （五）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生；
- 3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国

家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- （9）其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

#### 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最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- （3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （4）除为基金管理人进行基金投资外，不直接或间接进行其他股票交易，也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （六）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

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则

公司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

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

## 2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

（1）董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

（2）监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

（3）督察长：督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。

（4）合规与风险管理委员会：合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

（5）合规监察稽核部：合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，对督察长负责。

（6）各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员

工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

### 4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### （1）控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来，通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识，致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设，建立了公司内部控制体系。

#### （2）风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查，发现风险，将风险进行分类、按重要性排序，找出风险分布点，分析其发生的可能性及对目标的影响程度，评估目前的控制程度和风险高低，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后，确

定应进一步采取的对应措施，对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善，并监督各个环节的改进实施。

### （3）控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中，也得到了一贯的实施。主要包括：组织结构控制、操作控制、会计控制。

#### ① 组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工，及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成权责分明、严格有效的三道监控防线：

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

#### ② 操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

#### ③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；

会计账务的组织和处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

#### （4）信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司各级管理人员和员工可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

#### （5）内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查。检验其是否符合设计要求，并及时地充实和完善，反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势，确保内控制度的有效性。

### 5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2020年9月30日，本集团总资产81,567.00亿元人民币，高级法下资本充足率16.19%，权重法下资本充足率13.63%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工100人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投

资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最



佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12月荣获2019东方财富风云榜“2019年度最佳托管银行”奖。2020年1月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019年度优秀资产托管机构”奖项；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10月荣获《中国基金报》“2019年度最佳基金托管银行”奖。

## （二）主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020年9月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。十九届中央候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

刘波先生，招商银行资产托管部总经理。硕士研究生毕业，1999年7月加盟招商银行至今，历任招商银行重庆分行干部、总行计划财务部副经理、经理、高级经理、总行资产负债管理部总经理助理、深圳分行党委委员、行长助理、副

行长等职务，具有 20 余年银行从业经验，在资产负债管理、资本管理、资产证券化、统计分析、金融同业、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2020 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 690 只证券投资基金。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内部控制制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

#### 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，

不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险环节。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

#### 内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（3）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，根据法律法规和其他有关规定调用资料，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（4）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，

对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（5）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 五、境外托管人

### 一、基本情况

名称：布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）

地址：140 Broadway New York, NY 10005

法定代表人：William B. Tyree (Managing Partner)

组织形式：合伙制（Partnership）

存续期间：持续经营

成立于1818年的布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）是全球领先的托管银行之一。BBH自1928年起已经开始在美国提供托管服务；1963年，BBH开始为客户提供全球托管服务，是首批开展全球托管业务的美国银行之一。

BBH 的惠誉长期评级为 A+，短期评级为 F1。

### 二、全球托管业务及主要人员情况

布朗兄弟哈里曼银行的全球托管业务隶属于本行的投资者服务部 (Investor Services)。在全球范围内，该部门由本行合伙人Seán Páircéir 先生领导。在亚洲，该部门由本行合伙人Taylor Bodman先生领导。

作为一家全球化公司，BBH拥有服务全球跨境投资的专长，其全球托管网络覆盖近一百个市场。截至2019年6月30日，全球托管资产规模达到了4.4万亿美元，其中超过60%是跨境投资资产。亚洲是BBH业务增长最快的地区之一，我们投身于亚洲市场迄今已逾30年，亚洲区服务的资产超6,000亿美元。

投资者服务部是公司最大的业务部门，拥有近4,900名员工。我们致力为客户提供稳定优质的服务，并根据客户具体需求提供定制化的全面解决方案，真正

做到“以客户为中心”。

由于坚持长期提供优质稳定的客户服务，BBH 多年来在行业评比中屡获殊荣，

包括：



《全球托管人》

**2017年 行业领袖杰出奖**

获奖者-编辑选择奖：次托管服务-北美  
获奖者-共同基金管理 过户代理-北美

**2016年 行业领袖杰出奖**

获奖者-共同基金管理 托管服务-北美

**2015年 共同基金行政管理调查**

被评为“全球卓越者”

**2015年行业领袖杰出奖**

获奖者-共同基金管理 客户服务-北美

**2014年 代理银行调查**

#1 - 美国代理银行提供的资产服务

**2017 Industry Leaders Awards**

Editor's Choice Awards: North American Sub-Custody  
Mutual Fund Administration (North American clients):  
Transfer Agency

**2016 Industry Leaders Awards**

Mutual Fund Administration Custody Services: North  
America

**2015 Mutual Fund Administration  
Survey**

Rated 'Global Outperformer'

**2015 Industry Leaders Awards**

Mutual Fund Administration Client Service: North  
America

**2014 Agent Bank Survey**

#1 - Asset Servicing among US Agent Banks



《全球投资人》

### 2016年 全球托管银行调查

- #1 – 共同基金/UCITS – 美洲地区(原始分数)
- #2 – 使用多个托管人的客户 – 欧洲、中东和非洲地区(加权分数)

### 2015年 全球托管银行调查

- #1 – 使用多个托管人的客户 – 亚太地区(加权分数)
- #2 – 共同基金管理者(全球和仅美洲地区)

### 2014年 全球托管银行调查

- #1 – 资产管理规模超过30亿美元的客户 – 全球
- #1 – 资产管理规模超过30亿美元的客户 – 欧洲、中东和非洲
- #1 – 美洲共同基金管理人

### 2016 Global Custody Survey

- #1 Mutual funds/UCITS – Americas (raw score)
- #2 Clients Using Multiple Custodians - EMEA (weighted scores)

### 2015 Global Custody Survey

- #1 Clients using multiple custodians - Asia Pacific (weighted )
- #2 - Mutual Fund Managers (Global and Americas-only)

### 2014 Global Custody Survey

- #1 Clients with AuM over \$3 billion - Global
- #1 Clients with AuM over \$3 billion - EMEA
- #1 Americas Mutual Fund Managers



### 《ETF Express》

#### 2018年ETF Express 大奖

最佳欧洲ETF基金行政管理人

#### 2017年ETF Express 大奖

最佳北美ETF基金行政管理人

#### 2016年ETF Express 大奖

最佳欧洲ETF基金行政管理人

#### 2014年ETF Express 大奖

最佳北美ETF基金行政管理人

#### 2018 ETF Express Awards

Best European ETF Fund Administrator

#### 2017 ETF Express Awards

Best North American ETF Fund Administrator

#### 2016 ETF Express Awards

Best European ETF Fund Administrator

#### 2014 ETF Express Awards

Best North American ETF Fund Administrator



### 《R&M 调查》

**2014年 Global Custody.net 全球托  
管银行调查**  
#1 – 美洲

**2014 Global Custody.net Global  
Custody Survey**  
#1 Americas

### 三、境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、计算境外受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- 7、其他由基金托管人委托其履行的职责。



## 五、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

法定代表人：朱学华

成立日期：1998年6月4日

客户服务统一咨询电话：40088-50099

传真：021-58406138

公司网站：www.huaan.com.cn

##### （2）华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机APP平台：iPhone交易客户端、Android交易客户端

联系人：谢伯恩 2、代销机构

##### （1）中国银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街1号

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

##### （2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

##### （3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

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

（4）招商银行股份有限公司

注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客服电话：95555

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

（5）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

客服电话：95561

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

（6）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

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

（7）中国民生银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

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

（8）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客服电话：95594

网址：[www.bosc.cn](http://www.bosc.cn)

（9）广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：4008308003

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

（10）平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：谢永林

客服电话：95511

网址：bank.pingan.com

（11）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

（12）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：李伏安

客服电话：400-888-8811

网址：www.cbhb.com.cn

（13）大连银行股份有限公司

注册地址：辽宁大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

客服电话：4006640099

网址：www.bankofd1.com

（14）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：何沛良

客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

（15）河北银行股份有限公司

注册地址：石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

客服电话：400-612-9999

网址：www.hebbank.com

（16）嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：夏林生

客服电话：0573-96528

网址：www.bojx.com

（17）江苏常熟农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常熟市新世纪大道 58 号

法定代表人：宋建明

客服电话：4009962000

网址：www.csrcbank.com

（18）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（19）江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客服电话：96005

网址：www.jnbank.com.cn

（20）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服电话：96067

网址：www.suzhoubank.com

（21）晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦

法定代表人：上官永清

客服电话：95105588

网址：www.jshbank.com

（22）福建海峡银行股份有限公司

注册地址：福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行

法定代表人：苏素华

客服电话：400-893-9999

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

（23）深圳新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：马勇

客服电话：4001161188

网址：<https://8.jrj.com/>

（24）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

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

（25）上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客服电话：021-50810673

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

（26）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

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

（27）深圳众禄基金销售有限公司

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

法定代表人：薛峰

客服电话：4006788887

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

（28）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 号楼二层

法定代表人：其实

客服电话：4001818188

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

（29）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

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

（30）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

法定代表人：祖国明

客服电话：4000-766-123

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

（31）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：[www.e-rich.com.cn](http://www.e-rich.com.cn)

（32）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

法定代表人：易峥

客服电话：4008-773-772

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

（33）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人：闫振杰

客服电话：4008886661

网址：[www.myfp.cn](http://www.myfp.cn)

（34）华金证券股份有限公司

注册地址：上海市中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层

法定代表人：赵丽峰

客服电话：86-21-20655588

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

（35）联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

法定代表人：丁可

客服电话：86-755-36991929

网址：www.lczq.com

（36）玄元保险代理有限公司

注册地址：上海市中国（上海）自由贸易试验区锦康路 258 号 10 楼 02 单元

法定代表人：马永谔

客服电话：86-21-60795000

网址：www.100bbx.com

（37）长城华西银行股份有限公司

注册地址：四川省德阳市蒙山街 14 号

客服电话：86-28-61963297, 86-838-6821177

网址：www.gwbank.com.cn

（38）云南红塔银行股份有限公司

注册地址：云南省玉溪市东风南路 2 号

客服电话：86-877-2073343

网址：www.ynhtbank.com

（39）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

（40）嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（41）乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

法定代表人：王兴吉

客服电话：4000888080

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

（42）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

法定代表人：梁蓉

客服电话：400-6262-818

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

（43）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客服电话：4008 588 588

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

（44）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

网址：<http://www.yixinfund.com/>

（45）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

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

（46）北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客服电话：010-82350618

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

（47）众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元



法定代表人：李招弟

客服电话：400-876-9988

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（48）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

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

（49）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

法定代表人：兰奇

客服电话：400-101-9301

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

（50）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

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

（51）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

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

（52）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客服电话：4008188866

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

（53）一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

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

（54）海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人：刘惠

客服电话：400-808-1016

网址：<http://www.fundhaiyin.com>

（55）北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人：齐剑辉

客服电话：4006236060

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

（56）上海大智慧财富管理有限公司

注册地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

网址：<https://www.wg.com.cn/>

（57）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室

法定代表人：李振

客服电话：400-066-9355

网址：[fund.sina.com.cn/](http://fund.sina.com.cn/)

（58）北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

法定代表人：张琪

客服电话：400 803 1188

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

（59）济安财富(北京)资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

法定代表人：杨健

客服电话：400-075-6663

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

（60）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客服电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（61）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

客服电话：400-046-6788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

（62）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客服电话：400-820-2819

网址：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

（63）上海基煜基金销售有限公司

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

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

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

（64）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：4000 178 000

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

（65）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

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

（66）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

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

（67）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室

法定代表人：齐小贺

客服电话：0755-83999913

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

（68）武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢  
23层1号4号

法定代表人：陶捷

客服电话：4000279899

网址：<http://www.buyfunds.cn>

（69）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

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

（70）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

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

（71）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

法定代表人：温丽燕

客服电话：4000-555-671

网址：<https://www.hgccpb.com/>

（72）南京途牛金融信息服务有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

客服电话：4007-999-999

网址：<http://jr.tuniu.com>

（73）奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

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

（74）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

法定代表人：彭运年

客服电话：4008909998

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

（75）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

法定代表人：王苏宁

客服电话：95118

网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

（76）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

客服电话：4008201515

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

（77）深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人：赖任军

客服电话：4009500888

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

（78）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com/>

（79）上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦1585室

法定代表人：许欣

客服电话：400-700-9700

网址：<https://www.qiangungun.com/>

（80）天津万家财富资产管理有限公司

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

法定代表人：李修辞

客服电话：010-59013825

网址：<http://07a46813.atobo.com.cn/>

（81）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

法定代表人：李一梅

客服电话：400-817-5666

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

（82）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

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

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

（83）东海期货有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人：陈太康

客服电话：95531

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

（84）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

法定代表人：王常青

客服电话：95587

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

（85）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

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

（86）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

法定代表人：张佑君

客服电话：0755-23835888

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

（87）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：95551/4008-888-888

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

（88）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

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

（89）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：021-96250500

网址：<http://www.swhysc.com>

（90）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579

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

（91）民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：冯鹤年

客服电话：4006198888

网址：<http://www.msza.com>

（92）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路228号

法定代表人：周易

客服电话：95597

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

（93）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

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

（94）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：4008008899

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

（95）方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：高利

客服电话：0731-95571



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

（96）广州证券股份有限公司

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

法定代表人：邱三发

客服电话：020-83963933

网址：<http://www.gzs.com.cn>

（97）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20

法定代表人：刘世安

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

（98）华安证券有限责任公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

客服电话：95318

网址：<http://www.hazq.com>

（99）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

法定代表人：韩志谦

客服电话：4008000562

网址：<http://www.swhysc.com>

（100）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326

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

（101）华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：李晓安

客服电话：0931-4890619

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

（102）中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

客服电话：010-65051166

网址：<http://www.cicc.com.cn>

（103）财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201室，501室，502室，1103室，1601-1615室，1701-1716室

法定代表人：沈继宁

客服电话：95336

网址：<http://www.ctsec.com>

（104）华鑫证券有限责任公司

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

法定代表人：俞洋

客服电话：021-32109999

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

（105）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋4层、18-21层

法定代表人：高涛

客服电话：95532

网址：<http://www.china-invs.cn/>

（106）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服电话：4006-600109

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

（107）华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层

法定代表人：陈林

客服电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

（108）宏信证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客服电话：4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

（109）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

客服电话：95397

网址：www.tpyzq.com

（110）泉州银行股份有限公司

注册地址：泉州市云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

客服电话：400-889-6312

网址：www.qzccb.com

（111）深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心 A36 楼

法定代表人：顾敏

客服电话：4009998877

网址：www.webank.com

（112）中原银行股份有限公司

注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

法定代表人：窦荣兴

客服电话：96688

网址：www.zybank.com.cn

（113）南京银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区中山路 288 号

法定代表人：林静然

客服电话：86-25-86775067, 86-25-86775446

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

（114）江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：季明

客服电话：86-25-52890919

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

（115）江苏苏州农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号

法定代表人：庄颖杰

客服电话：86-512-63969966, 86-512-63969870

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

（116）四川天府银行股份有限公司

注册地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段 97 号 26 栋

法定代表人：黄毅

客服电话：86-817-8188888

网址：[www.cgnb.cn](http://www.cgnb.cn)

（117）浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省绍兴市柯桥区柯桥笛扬路 1363 号

法定代表人：章伟东

客服电话：86-575-81105353

网址：[www.borf.cn](http://www.borf.cn)

（118）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

法定代表人：陈洪生

客服电话：86-592-3128888, 86-592-8060888, 86-592-3122716

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

（119）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

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166 转 849

网址：<http://www.huilinbd.com/>

（120）大河财富基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市高新区湖滨路 109 号瑜赛进丰高新财富中心 26 层  
1 号

法定代表人：赵鹰龙

客服电话：0851-88235678

网址：<http://www.urainf.com/>

（121）腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：刘明军

客服电话：95017（拨通后转 1 转 8） |

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

（122）北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：许冬亮

客服电话：95055

网址：<https://www.duxiaoman.com/>

（123）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

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

（124）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

法定代表人：王军辉

客服电话：4006-802-123

网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

（125）上海钜派钰茂基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼

法定代表人：洪思夷

客服电话：400-021-2428

网址：<https://www.jpinvestment.cn/>

（126）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

网址：<https://www.yibaijin.com>

（127）洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室

法定代表人：李赛

客服电话：400-8189-598

网址：<https://www.hongtaiwealth.com/>

（128）南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 389 号

法定代表人：夏宏建

客服电话：86-25-58519900

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

基金管理人可以根据实际情况增加或减少销售代理机构，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号二期 31-32 层

法定代表人：朱学华

电话：（021）38969999

传真：（021）33627962

联系人：赵良

客户服务中心电话：40088-50099

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358716

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507  
单元 01 室

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：楼茜蓉

经办注册会计师：魏佳亮、楼茜蓉

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，经中国证监会证监许可【2014】347号文注册。

本基金自2014年7月14日起向全社会公开募集，截至2014年8月8日募集工作顺利结束。

本基金为ETF联接基金。运作方式为契约型开放式，存续期限不定期。

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为1,098,368,212.99元人民币，折合基金份额1,098,368,212.99份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计528,545.63元人民币，折合基金份额528,545.63份。本次募集所有资金已于2014年8月12日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为8,170户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计1,098,896,758.62份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。其中，华安基金管理有限公司基金从业人员认购持有的基金份额总额为14,907.29份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为0.0014%。按照有关法律规定，本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。



## 七、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2014 年 4 月 1 日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点详见本招募说明书“十九、相关服务机构”部分相关内容以及销售机构在当地以各类形式发布的公告。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。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并在基金管理人网站公示。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日的开放时间办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所、德国证券交易所同时开放交易的工作日，但本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。本基金的开放时间为每个开放日的 9:30-11:30 和 13:00-15:00。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2014 年 9 月 15 日起，开始办理申购、赎回业务。

基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间或非开放日受理投资者的申购、赎回申请，届时以基金管理人或者销售机构的公告为准。如果本基金接受投资者在非开放时间提出申购、赎回申请且注册登记机构接受的，其基金份额申购、赎回或转换的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，即基金份额申购、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、本基金采用“金额申购、份额赎回”的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、本基金赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，按照基金份额持有人认购、申购确认的先后次序进行顺序赎回；亦即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

5、如外管局规定发生变化或在未来条件成熟时，本基金可增减外币基金份额类别或开通不同基金份额类别之间的转换，赎回币种与其对应份额的认购/申购币种相同。

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

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金份额持有人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以开放时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在T+2日内对该申请的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者可在T+3日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式及时查询申请的确认情况。基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则，对上述业务办理时

间进行调整，并于开始实施前按照有关规定予以公告。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者，基金管理人或基金管理人指定的代销机构不承担由此产生的利息等任何损失。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+10 日内将赎回款项划往基金份额持有人账户，但中国证监会另有规定除外；如基金投资所处的主要市场有一个或一个以上休市时，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在最迟不超过 T+10 日内将赎回款项划往基金份额持有人账户。国家外汇管理相关规定有变更或本基金所投资市场的交易清算规则有变更时，赎回款支付时间将相应调整。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

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

#### （五）申购和赎回的数额和金额限制

1、每个基金账户首次申购的最低金额为人民币 1 元，每次追加申购的最低金额为人民币 1 元。各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。投资者已成功认购过本基金时则不受首次最低申购金额 1 元限制；投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制；

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

3、单个投资者累计持有的基金份额不设上限；

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。具体规定请参见相关公告；

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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（六）申购费用和赎回费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，C 类基金份额在申购时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

1、申购费率

本基金 A 类基金份额采用前端收费的方式进行申购，申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金 C 类基金份额在申购时不收取申购费。具体费率如下表所示：

份额类型	申购金额 M（元）（含申购费）	申购费率
A 类基金份额	M < 100 万	1.2%
	100 万 ≤ M < 300 万	0.8%
	300 万 ≤ M < 500 万	0.4%
	M ≥ 500 万	每笔 1000 元
C 类基金份额	0	

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率为 500 元/笔。

A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费率

本基金的赎回费率按持有期递减，具体费率如下：

份额类型	持有时间（天）	赎回费率
A 类基金份额	Y < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ Y < 1 年	0.5%
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
	Y ≥ 2 年	0
C 类基金份额	Y < 7 天	1.50%
	Y ≥ 7 天	0

注：一年指 365 天，两年为 730 天

本基金的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 A 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、基金申购份额的计算

（1）对于 A 类基金份额，申购金额包括申购费用和净申购金额。具体计算公式如下：

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

$$\text{或，净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定申购费金额}$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额，或，固定申购费金额}$$

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

例三，某投资者（非养老金客户）投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98814.23 / 1.015 = 97,353.92 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额

净值为 1.015 元，则可得到 97,353.92 份 A 类基金份额。

例四，某投资者（非养老金客户）一次性投资 5000 万元申购本基金 A 类基金份额，对应单笔申购费为 1000 元，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000,000 - 1,000 = 49,999,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,999,000 / 1.015 = 49,260,098.52 \text{ 份}$$

即投资者投资 5000 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则可得到 49,260,098.52 份 A 类基金份额。

（2）对于 A 类基金份额，具体计算公式如下：

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

例五，投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.015 = 98,522.17 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元，则可得到 98,522.17 份 C 类基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日该类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

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

例五，某投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额，持有期三个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.015 = 101,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 101,500 \times 0.5\% = 507.50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 101,500 - 507.50 = 100,992.50 \text{ 元}$$

即投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额，持有期三个月，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

例六，某投资者赎回本基金 10 万份 C 类基金份额，持有期三个月，赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.015=101,500.00 元

赎回费用=101,500.00×0%=0.00 元

赎回金额=101,500.00-0.00=101,500.00 元

即投资者持有本基金 10 万份 C 类基金份额，持有期三个月，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 101,500.00 元。

### 3、基金份额净值的计算

各类基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内披露。计算公式为计算日各类基金资产净值除以计算日发售在外的该类基金份额总数。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可适当延迟计算或公告。

本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

### 5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

## （八）申购和赎回的注册登记

1、投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+2 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日（包括该日）后有权赎回该部分基金份额。

2、投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+2 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

3、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## （九）拒绝或暂停申购的情形及处理

如果出现如下情形，基金管理人可暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；



- 2、目标 ETF 暂停申购、赎回或交易；
- 3、目标 ETF 暂停基金资产估值；
- 4、本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 5、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；
- 6、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；
- 7、基金管理人、基金托管人、销售机构或注册登记机构因技术保障不充分或人员伤亡导致基金销售系统或注册登记系统、证券登记结算系统或基金会计系统无法正常运行；
- 8、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 9、基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）；
- 10、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- 11、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；
- 12、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；
- 13、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将相应退还投资者。发生上述 1 到 9 项、第 11 到 13 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介刊登暂停申购公告。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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

- 1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、目标 ETF 暂停申购、赎回或交易；
- 3、目标 ETF 暂停基金资产估值；
- 4、本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场交易时间非正常停市，可能影响本基金投资，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 5、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 6、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日、休市，并可能影响本基金正常估值与投资；
- 7、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，继续接受赎回可能会影响或损害其他基金份额持有人利益；
- 8、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 9、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；
- 10、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赎回或者延期支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已确认的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被确认的赎回申请量占已确认赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法延期支付。

同时，在出现上述第 5 项的情形时，对已确认的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间 20 个工作日，并在指定媒介公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

#### (十一)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)超过上一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

## 2. 巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。

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

## (4) 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过指定媒介刊登公告。同时通过邮寄、传真或者《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法。

## (十二) 重新开放申购或赎回的公告

1. 暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个估

值日的各类基金份额净值。

2. 基金管理人也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

（十三）基金的非交易过户、转托管、解冻、冻结与质押等其他业务

基金注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、转托管、冻结、解冻与质押等业务，并收取一定的手续费用。

（十四）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，但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。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于目标 ETF、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、德国 DAX 指数成份股及备选成份股、跟踪德国 DAX 指数的股指期货等金融衍生品、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具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相关规定）。

本基金投资于目标 ETF 基金的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制，不需经基金份额持有人大会审议。

### （三）投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪，正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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，减小与标的指数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。本基金在目标 ETF 上市前，可通过特殊申购的方式完成对目标 ETF 的建仓。

为了更好地对外币资金进行投资管理，本基金还可以与目标 ETF 或其他 QDII 基金进行

外汇互换，互换价格需遵循公允、合理的原则以及监管机构的相关规定。

#### （四）投资限制

##### 1. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）购买不动产；
- （5）购买房地产抵押按揭；
- （6）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （7）购买实物商品；
- （8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- （9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （10）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- （12）直接投资与实物商品相关的衍生品；
- （13）向基金管理人、基金托管人出资；
- （14）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （15）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的

其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制，不需经基金份额持有人大会审议。

除非法律法规和监管部门禁止，本基金可以投资境外托管人发行的金融产品。

## 2. 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。本款所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（2）基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

（3）基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或《基金合同》规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（4）基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受前述限制。

（5）基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

（6）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准。

（7）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。若基金超过上述（1）-（6）项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合投资比例限制要求。

由于本基金的申购赎回和目标 ETF 的申购赎回存在确认和交收时间上的差异，基金规模变动可能导致基金投资比例在短期内不符合基金合同的约定，此外，因证券市场波动、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟等因素也可能致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定，对于上述情形，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但因目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟致使不能在 10 个交易日内完成调整的，基金管理人应当在合理时间内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款约定的投资组合限制被修改或取消的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### 3. 金融衍生品投资

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

(1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

(2) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金拟投资衍生品，基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的风险管理流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

(5) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

(6) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

### 4. 关于投资境外基金的限制

(1) 每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

(2) 本基金不得投资于以下基金：

1) 其他基金中基金；

2) 联接基金（A Feeder Fund）；

3) 投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

5. 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：



(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

- 1) 现金；
- 2) 存款证明；
- 3) 商业票据；
- 4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有

关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

7. 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

#### （五）标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为德国 DAX 指数（DAX Index）。

本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的标的指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。

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

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

#### （六）风险收益特征

本基金属于 ETF 联接基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，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，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

本基金为境外证券投资的基金，主要投资德国证券市场上市的德国企业，需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金投

投资者的利益；

2、基金管理人代表基金行使相关权利时遵循有利于基金资产的安全与增值的原则。

#### （八）基金的融资融券

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融资融券。

#### （九）基金的投资组合报告

### 1、重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2020年12月31日。

### 2. 基金投资组合报告

#### 2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	809,397,638.28	94.25
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-

	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	48,068,906.18	5.60
8	其他各项资产	1,356,152.13	0.16
9	合计	858,822,696.59	100.00

## 2.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华安德国30(DAX)ETF(QDII)	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	809,397,638.28	95.21

## 2.3 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 2.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 2.5 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

**2.6 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**2.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**2.10 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	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	华安德国30(DAX)ETF(QDII)	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	809,397,638.28	95.21

**2.11 投资组合报告附注**

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

2.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**2.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	10,676.05
2	应收证券清算款	881,103.07
3	应收股利	-
4	应收利息	5,058.72
5	应收申购款	459,314.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,356,152.13

#### 2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较（截止时间2020年6月30日）

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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1月1日-2020年6月30日	0.99%	2.28%	-4.88%	2.60%	5.87%	-0.32%
2019年1月1日-2019年12月31日	19.14%	0.85%	23.67%	0.89%	-4.53%	-0.04%
2018年1月1日-2018年12月31日	-18.09%	0.95%	-16.91%	1.01%	-1.18%	-0.06%
2017年1月1日-2017年12月31日	16.37%	0.69%	19.10%	0.70%	-2.73%	-0.01%
2016年1月1日-2016年12月31日	6.69%	1.27%	9.67%	1.31%	-2.98%	-0.04%

2015年1月1日-2015年12月31日	1.83%	1.44%	4.23%	1.55%	-2.40%	-0.11%
2014年8月12日（基金成立日）-2014年12月31日	-1.60%	0.78%	-3.22%	1.32%	1.62%	-0.54%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。



## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规开立基金资金账户以及证券账户，开立的基金账户与基金管理人、基金托管人、境外托管人、代销机构和注册登记机构的自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （四）基金财产的保管及处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的财产，并由基金托管人和/或其委托的境外托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、注册登记机构和代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；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。

在符合《基金合同》和《托管协议》有关资产保管的要求下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。基金托管人存在故意或过失行为的，应承担赔偿责任。

基金管理人和基金托管人可将其义务委托第三方，并对第三方处理有关本基金事务的行为承担责任。

除非基金管理人、基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金管理人、基金托管人将不保证基金托管人或境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

基金托管人和境外托管人应妥善保存基金管理人基金财产汇入、汇出、兑换、收汇、现金往来及证券交易的记录、凭证等相关资料，并按规定的期限保管，但境外托管人持有的与境外托管人账户相关的资料的保管应按照境外托管人的业务惯例保管。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回、转换等提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为本基金的开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日。

### （三）估值对象

基金所持有的目标 ETF、基金、股票、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产和负债。

### （四）估值方法

#### 1、目标 ETF 估值方法

对持有的目标 ETF 基金，按估值日目标 ETF 基金的份额净值估值。如该日目标 ETF 未公布净值，则按目标 ETF 最近公布的净值估值。

#### 2、已上市流通的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证、存托凭证、除目标 ETF 外的其他 ETF 基金等），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，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

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

#### 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、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难

以可靠计量的情况下，按成本估值；

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

(4) 对于首次发行未上市的债券按成本价估值；对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，其中成熟市场的债券按估值日的最近买价估值；新兴市场的债券按估值日的最近买价和卖价的均值估值。

4、开放式基金的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

5、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

#### 6、衍生品估值方法

(1) 上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值；若衍生品价格无法通过公开信息取得，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时告知基金托管人。

7、基金持有的其他有价证券，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的有价证券投资按估值日在证券交易所挂牌的该证券投资的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的其他有价证券投资按公允价估值；

8、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-7 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。

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

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

#### 11、估值中的汇率选取原则：

(1) 人民币对主要外汇的汇率应当以中国人民银行或其授权机构最新发布

的人民币汇率中间价为准。

（2）其他货币与人民币的汇率则以估值日伦敦时间下午四点（或能够取到的离下午四点最近时点）由彭博信息(Bloomberg)提供的其他币种与美元的中间价套算。

若无法取得上述汇率价格信息时，以托管银行招商银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值。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。

#### 12、估值中的税收处理原则：

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可以聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

#### （五）估值程序

基金管理人与基金托管人可以委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值承担的责任。

基金日常估值由基金管理人（或其授权代理人）同基金托管人（或其授权代理人）分别进行。各类基金份额净值由基金管理人（或其授权代理人）完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人（或其授权代理人），基金托管人按《基金合同》和《托管协议》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

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财产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护；

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、法律法规、《基金合同》约定以及中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个估值日的截止时间后计算开放日当日的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，由基金管理人对各类基金份额净值予以公布，如因基金管理人的计算结果错误，给基金份额持有人造成损失的，由基金管理人自行承担，基金托管人不承担责任。基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

各类基金份额净值的计算均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### （八）估值错误的处理

1、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出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

2、任一类基金份额净值计算差错小于该类基金份额净值 0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；当错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人、公告并报中国证监会备案。

3、关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### （1）差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术不能预见、不能避免、并不能克服的客观情况，按下列有关不可抗力的约定处理。

因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### （2）差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失，在基金管理人可承担的范围内应首先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿，本合同的当事人应将按照以下约定处理。

1) 如采用本合同或托管协议中估值方法进行处理，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成投资者损失的，由双方根据过错程度按照管理费和托管费的比例承担相应的责任；

2) 如基金管理人采用规定估值方法外的方法确定一个价格进行估值的情形并已告知基金托管人的情形下，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现或未提出异议，且造成投资者损失的，双方按照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任一类基金份额净值的计算结果不能达成一致时，为避免不能按时公布该类基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，基金管理人应在单方面对外公告基金净值计算结果时注明未经基金托管人复核，基金托管人有权将有关情况向监管机构报告，由此给投资者和基金造成的损失，由基金管理人承担赔偿责任，但因基金托管人故意或过失没有尽到复核义务的，基金托管人承担相应责任；

4) 如基金管理人未经基金托管人复核，单方面对外公告基金净值计算结果

应该在公告上标明未经基金托管人复核。因基金管理人未经基金托管人复核而单方面对外公布的基金净值计算结果或公告的计算结果与基金托管人（最终）复核结果不一致而造成的损失，由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任；

5) 由于证券交易所、交易市场、登记结算公司或数据供应商发送的数据错误，经纪商或交易对家未能及时确认交易及详细交易资料或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响；

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

7) 法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，基金管理人和基金托管人双方应本着平等和保护基金持有人利益的原则进行协商；

8) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

10) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，



则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

11) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

12) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿，但该第三方是由基金托管人委托的情况下，应由基金托管人负责赔偿并向差错方追偿。

13) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

14) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人任一类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责

发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

## 十三、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，包括：

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入；
- 5、持有期间产生的公允价值变动（该部分收益不得用于支付基金的利润分配）；
- 6、外汇汇兑损益；

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）期末可供分配利润

期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。期末可供分配利润计算截止日即收益分配基准日。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、同一类别内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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准。

4、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别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。

基金管理人可在不影响基金份额持有人权益的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、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）收益分配的时间和程序

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人对相关财务数据进行复核，由基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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

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，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、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，含境外托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的基金销售服务费；
- 4、基金投资目标ETF的相关费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用）；
- 6、《基金合同》生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、基金收益分配过程中发生的费用；
- 10、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 11、《基金合同》生效以后的会计师费、律师费和税务顾问费；
- 12、基金的资金汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 13、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
- 14、基金依照有关法律法規应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；
- 15、为了基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用；
- 16、按照国家有关法律法規规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

### （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。在通常情况下，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 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

本基金的管理费按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人出具划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。在首期支付基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。如需要变更收款账户，基金管理人应提前 10 个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。

## 2、基金托管人的基金托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人出具划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，在通常情况下，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 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人出具划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如资产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

5、本条第（一）款第 4 至第 16 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

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等不列入基金费用。

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

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

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

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

调高基金管理费率、基金托管费率、C 类基金份额的销售服务费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非《基金合同》、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费、基金托管费和 C 类基金份额的销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按规定在指定媒介上刊登公告。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家或所投资市场所在国家的法律法规的规定履行纳税。



## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表。
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
- 8、基金管理人在会计年度结束后60个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

### （二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 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，并在更换会计师事务所后2日内在指定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

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

本基金的信息披露采用中文。

（一）《招募说明书》、基金产品资料概要、《基金合同》、《托管协议》

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将《招募说明书》、《基金合同》摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、《托管协议》登载在各自公司网站上。

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

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

（二）《基金份额发售公告》

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《基金份额发售公告》，并在披露《招募说明书》的当日登载于指定报刊和网站上。

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应

当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在不晚于每个开放日后的第 2 个工作日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日后的第 2 个工作日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 2 个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、

年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。中国证监会认定的特殊情形除外。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （七）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- 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、境外托管人、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、境外托管人的法定名称、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、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到

重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

15、基金收益分配事项；

16、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；

17、任一类基金份额净值错误偏差达该类基金份额净值 0.5%；

18、基金开始办理申购、赎回；

19、基金发生巨额赎回并延期办理；

20、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；

21、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、基金变更标的指数；

23、变更目标 ETF；

24、开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回及相应业务规则调整；

25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

26、调整基金份额类别的设置；

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和基金合同约定所规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》期限内，任何公共媒体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将有关情况报告上海证券交易所，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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决

方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十）清算报告

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

#### （十一）信息披露文件的存放与查阅

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

## 十七、风险揭示

### （一）本基金特有的风险

#### 1、投资标的指数的特有风险

本基金所追踪的 DAX 指数（DAX Index）是全球最著名的欧洲旗舰指数之一，成份股包含了 40 家在德国法兰克福股票交易所主板市场上市的规模最大、交易最活跃的德国公司股票，指数市值覆盖度达到德国市场的 70%，是全球公认的最能代表德国经济表现的蓝筹基准指数。指数在反映德国蓝筹股票市场平均收益的同时也承担相应的市场风险。

#### 2、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 3、标的指数波动的风险

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

#### 4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

（3）标的指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

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

（5）因法律法规的限制或其他限制，本基金不能投资于部分标的指数成份股。在使用替代方法，如投资同行业中相关性较高的股票以替代上述投资受限股

票时，会产生一定的跟踪偏离度和跟踪误差。

（6）基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

（7）在本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，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

（8）其他因素产生的偏离。如因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### 5、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。

#### 6、成份股停牌的风险

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

（1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（2）在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 7、成份股退市的风险

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

#### 8、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指



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

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

### 9、标的指数变更的风险

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

#### （二）海外投资的特殊风险

##### 1、市场风险

市场风险是指由于市场因素如基础利率、汇率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化，并产生损失的可能性。

由于本基金将投资于德国股票市场，因此一方面基金净值会因德国股票市场的整体变化而出现价格波动。另一方面由于德国所特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势等也将对基金的业绩产生影响。另外由于德国的证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险的增加。

##### 2、汇率风险

本基金每日的基金资产净值以人民币计价，但本基金所投资资产大部分以欧元计价，因此当欧元与人民币汇率发生变动时，将会影响到人民币计价的基金资产净值，对于以人民币认购或申购本基金的投资者将面临由于汇率变动导致的风险。

##### 3、法律风险

由于德国所适用法律法规与中国法律法规有所不同的原因，可能导致本基金的某些投资行为在德国受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。

#### 4、境外上市公司经营风险

境外上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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。虽然本基金通过指数化投资可以尽可能分散这种非系统风险，但不能完全规避。

#### 5、税务风险

本基金在德国市场进行投资时，需按照当地税务法律法规就股息、利息、资本利得等收益向税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。德国税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该国缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

本基金在投资德国证券市场时会事先了解清楚当地的税务法律法规，同时，在境外托管人的协助下，完成投资所在国家或地区的税务扣缴工作。

### （三）基金投资的一般风险

#### 1、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。各个国家或地区的利率变动还将影响该地区的经济与汇率等。

但本基金主要投资于股票，利率的波动仅间接影响到股市，因此利率风险对本基金的影响相对较低。

#### 2、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### 3、流动性风险评估及流动性风险管理工具

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使基金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

由于境外市场的交易日、交易时间、结算规则等与国内存在一定的差异，本基金有关申购、赎回的开放的安排不同于国内一般开放式基金。本基金赎回款项到达投资者指定账户需要更长的时间。对于采用不同币种认购本基金的投资者，收到赎回款项的时间也可能根据所赎回币种的不同而有所差异。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“九、基金份额的申购和赎回”章节。

#### （2）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1) 基金合同约定：“本基金主要投资于目标 ETF、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、德国 DAX 指数成份股及备选成份股、跟踪德国 DAX 指数的股指期货等金融衍生品、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具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相关规定）”，其中“投资于目标 ETF 基金的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）”，从投资范围和投资市场上看，基金资产的流动性良好；

2) 从投资限制上看，基金合同约定：“基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%”。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- 1) 暂停接受赎回申请；
- 2) 延缓支付赎回款项；
- 3) 延期办理；
- 4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见招募说明书“九、基金份额的申购和赎回”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

（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  
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) 暂停接受赎回申请

具体措施，详见招募说明书“九、基金份额的申购和赎回”中“（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”的相关内容。

- 2) 延缓支付赎回款项或延期办理

上述具体措施，详见招募说明书“九、基金份额的申购和赎回”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

- 3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

- 4) 暂停基金估值

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基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

- 5) 中国证监会认定的其他措施。

#### 4、信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒

绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

#### 5、衍生品风险

衍生工具是为了有效管理金融风险而设计的工具，一般是一种私人合约，其价值是从一些基础资产价格、参考利率或指数中派生出来的。由于事先涉及的现金流相对较少，所以衍生工具有杠杆作用，即涉及借款问题。然而，杠杆作用是一把双刃剑。一方面，由于交易成本非常低，杠杆作用可使衍生工具成为一种对冲风险和投机的有效工具；另一方面，由于事先涉及的现金支付较少，因此就更加难以评估潜在的下跌风险。

本基金投资衍生品的目的是为了能够更好地实现跟踪标的指数的投资目标，而不是投机，会通过控制规模、计算风险价值等手段来有效控制风险。

#### 6、正回购/逆回购

在回购交易中，交易对手方可能因财务状况或其它原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响。

#### 7、证券借贷

作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失。

#### 8、操作风险

本基金境外投资涉及复杂的业务环节及不同的当事方，在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险；本基金后台运作中，可能因为技术系统故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。

##### (1) 系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

##### (2) 金融模型风险

金融模型风险是指由于投资决策或风险管理依赖的金融模型错误或参数不准确而引发的风险。

(3) 人为操作失误风险

基金经理或交易员在境外证券投资管理业务过程中由于人为失误，造成错误指令或错误交易，从而引发操作风险，给投资者带来损失。

9、其他风险

- (1) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- (2) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- (3) 因业务竞争压力可能产生的风险；
- (4) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- (5) 其他意外导致的风险。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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、基金份额持有人大会决定的《基金合同》变更应在决议生效后执行，自《基金合同》变更生效之日起按规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、法律法规和中国证监会规定的其他情形。

《基金合同》终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、《基金合同》终止，应当按法律法规和《基金合同》的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立

基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和《托管协议》的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

### 3、清算程序

- (1) 《基金合同》终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金剩余财产进行分配。

### 4、清算费用

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

### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 6、基金财产清算的公告



基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 二十一、对基金投资人的服务

本公司承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，适时对服务项目进行调整。主要服务内容如下：

### （一）投资人对账单服务

本公司在每个自然年度结束后 20 个工作日内向定制纸质对账单的基金份额持有人寄送纸质对账单；每月向定制电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。

### （二）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供 7X24 小时的基金净值信息、投资人账户交易情况、基金产品与服务等信息的自助查询。

客户服务中心人工座席在交易日提供人工服务，基金投资人可以通过客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、账户资料修改等专项服务。

### （三）网络在线服务

投资人可以通过本公司网站的“在线客服”在线就基金投资、交易操作中的各种问题进行咨询互动或留言。

### （四）信息定制服务

投资人可以通过拨打本公司客服热线、发送邮件或者直接登录本公司网站定制电子对账单及资讯服务等各类信息服务。

### （五）投诉受理服务

投资人可以通过各销售机构网点柜台、客服热线人工服务、在线客服、客服电子邮箱、纸质信函等多种不同的渠道提出投诉或意见。本公司对于工作日期间受理的投诉，原则上在受理投诉后 2 个工作日内回复；对于非工作日提出的投诉，将在顺延的 2 个工作日内进行回复。

### （六）网站交易服务

依据相关的招募说明书、基金合同的约定以及《业务规则》的规定，本公司可向个人投资人和机构投资者提供基金电子直销交易服务。具体业务规则详见基金管理人网站说明。

（七）基金管理人客户服务联系方式

客户服务中心热线：40088-50099（免长途话费）

客户服务传真：（021）33626962

公司网址：www.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

客服地址：上海市四平路 1398 号 同济联合广场 B 座 14 楼

邮政编码：200092

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

## 二十二、其他应披露事项

1. 近三年基金管理人及其高级管理人员没有受到过中国证监会及工商、财税等有关机关的处罚。

### 2. 本期公告事项

序号	公告事项	信息披露媒介名称	披露日期
1	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-21
2	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
3	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
4	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
5	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
6	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
7	华安国际龙头（DAX）交易型开放式	《中国证券报》、中	2020-03-07

	指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要（2020年第1号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	
8	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（2020年第1号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
9	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
10	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
11	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-16
12	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-20
13	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停申购及定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
14	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25

		站	
15	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
16	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金参加招商银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-07
17	关于华安德国 30（DAX）ETF 联接证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-07
18	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-11
19	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
20	华安基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-24
21	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金恢复申购及限制大额申购、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-12
22	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公	《中国证券报》、中国证监会基金电子	2020-05-21



	告	披露网站和公司网站	
23	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-03
24	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
25	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
26	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30
27	华安国际龙头（DAX）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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-07-21
28	关于旗下基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-08
29	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-15

30	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-22
31	华安基金管理有限公司关于暂停深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-25
32	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-28
33	华安国际龙头（DAX）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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-31
34	华安基金管理有限公司关于暂停深圳市锦安基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-04
35	华安基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-08
36	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-11
37	华安基金管理有限公司关于暂停上海有鱼基金销售有限公司办理旗下	《中国证券报》、中国证监会基金电子	2020-09-11

	基金相关销售业务的公告	披露网站和公司网站	
38	关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-24
39	关于暂停中民财富基金销售(上海)有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-24
40	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
41	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
42	关于旗下基金参加嘉兴银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-29
43	关于暂停前海凯恩斯基金销售有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-30
44	关于旗下基金参加中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-09

		站	
45	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-17
46	华安国际龙头（DAX）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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-27
47	华安基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-28
48	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停大额申购及大额定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-29
49	关于华安旗下部分基金增加云南红塔银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-19
50	关于旗下基金参加宁波银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-26
51	华安基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司等三家销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-15
52	华安基金管理有限公司关于旗下所	《中国证券报》、中	2020-12-18

	有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	
53	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-18
54	华安基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-23
55	关于华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定期定额投资的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
56	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
57	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-30
59	华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020	中国证监会基金电子披露网站和公司	2021-01-21

	年第 4 季度报告	网站	
60	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-02-06

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

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

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件

- 1、中国证监会准予证券投资基金募集注册设立的文件
- 2、基金合同
- 3、法律意见书
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、托管协议
- 7、中国证监会要求的其他文件

### （二）存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇二二年二月二十二日



## 附件一：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利

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，办理基金备案手续；
- （2）自《基金合同》生效之日起，依照法律法规和《基金合同》独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规及注册登记机构相关业务规则和《基金合同》的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、冻结、收益分配等方面的业务规则；在不违反法律法规规定的情况下，增加、减少或调整基金份额类别及销售币种；
- （4）根据法律法规和《基金合同》的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （5）根据法律法规和《基金合同》的规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行《基金合同》的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或《基金合同》规定对基金财产、其他《基金合同》当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关《基金合同》当事人的利益；
- （7）根据《基金合同》的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构，办理注册登记业务，并按照《基金合同》规定对注册登记机构进行必要的监督和检查；
- （9）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行

融资、融券；

（11）依据法律法规和《基金合同》的规定，制订基金收益分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（14）依据法律法规和《基金合同》的规定，召集基金份额持有人大会；

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

（16）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（17）法律法规、《基金合同》规定的其他权利。

## （二）基金管理人的义务

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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律法规规定，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；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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）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；

（7）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得为自己及任

何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定；

（12）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

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

（14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料 15 年以上；

（17）确保投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式，随时查阅到公开披露的基金信息，并在支付合理成本后得到有关资料的复印件；

（18）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；

（19）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；

（20）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；

（21）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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（22）基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（23）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（24）公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额

持有人的利益及资源分配；

（25）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，基金合同另有约定的除外；

（26）法律法规、《基金合同》及中国证监会规定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利

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，依据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会；

（6）选择、更换境外托管人，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

（7）法律法规、《基金合同》规定的其他权利。

### （四）基金托管人的义务

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）安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户；

（4）按照有关法律法规、《基金合同》的规定以受托人名义或指定的代理人名义登记资产；

（5）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得以基金财产

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；

（6）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

（7）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》约定的投资目标和限制进行管理；

（8）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；

（9）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（10）按照有关法律法规和《基金合同》的约定，执行基金管理人投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

（12）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（13）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；

（14）按规定从基金管理人处取得并保存基金份额持有人名册资料；

（15）复核、审查基金管理人计算的基金净值信息、各类基金份额申购、赎回价格，确保各类基金份额净值按照有关法律法规、《基金合同》规定的方法进行计算；

（17）确保基金根据有关法律法规、《基金合同》确定并实施收益分配方案；

（18）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；

（20）按照规定监督基金管理人的投资运作；

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

（22）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；

（23）因违反《基金合同》导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不

因其退任而免除；

（24）基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（25）保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

（27）每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

（28）基金托管人应办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务。

（29）基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

（30）法律法规、《基金合同》规定的其他义务以及中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的基金托管人的其他职责。

#### （五）基金份额持有人的权利

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9）按照本基金合同的约定，出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持

有人大会，对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(10) 法律法规、《基金合同》规定的其他权利。

(六) 基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、《基金合同》及其他有关规定；

(2) 交纳基金认购、申购款项及《基金合同》规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他《基金合同》当事人合法利益的活动；

(5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(7) 法律法规及《基金合同》规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

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 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 基金份额持有人大会的，由本基金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。

(二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外，或由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的除外）；

(5) 变更基金份额持有人大会程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规和中国证监会要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；

(8) 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；

(9) 本基金与其他基金的合并；

(10) 对《基金合同》当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(11) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，在法律法规和本《基金合同》规定的范围内，在不影响持有人利益的前提下，可由基金管理人和基金托管人协商后修改《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；



- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在变更基金的申购费率、降低赎回费率或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动必须对《基金合同》进行修改；
- (5) 《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；
- (6) 基金管理人在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户等业务的规则；
- (7) 增加、减少、调整基金份额类别设置；
- (8) 在不违反法律法规的情况下，调整或增加基金的申购赎回方式；
- (9) 在不违反法律法规的情况下，增加、减少或调整基金销售币种；
- (10) 由于目标 ETF 交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；
- (11) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、当基金规模小于 5000 万元人民币或基金持有人数小于 200 人或前十大持有人持有基金份额比例达到 90%，基金管理人有权终止《基金合同》而无需召开基金份额持有人大会。

### (三) 召集人和召集方式

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

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

3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金

托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上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。

4. 代表基金份额 10%以上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%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

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。

#### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。

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

(3) 通讯方式开会指按照本《基金合同》的相关规定以通讯的书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定。

##### 2. 召开基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一，下同)；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，下同）。

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

(2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

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

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

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

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

(3)在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(4)在会议的召开方式上，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或

者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## （六）议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

（1）议事内容为本《基金合同》规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 30 天前提交召集人并由召集人公告。

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

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

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

（4）单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议

的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

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

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

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

### (2) 通讯方式开会

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

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 一般决议

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

## (2) 特别决议

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

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## (八) 计票

### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主

持有人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## (九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项自完成备案手续之日起生效。

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

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

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

## 三、基金合同的变更、终止的事由、程序

### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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、基金份额持有人大会决定的《基金合同》变更应在决议生效后执行，自《基金合同》变更生效之日起按规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、法律法规和中国证监会规定的其它情形。

《基金合同》终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、《基金合同》终止，应当按法律法规和本《基金合同》的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和《托管协议》的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基

金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 3、清算程序

- (1) 《基金合同》终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金剩余财产进行分配。

### 4、清算费用

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

### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 四、争议解决方式

- (一) 本《基金合同》适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本《基金合同》的当事人之间因本《基金合同》产生的或与本《基金合同》有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本《基金合同》的其他部分应当由本《基金合同》当事人继续履行。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 附件二：托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

法定代表人：朱学华

成立日期：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期限：持续经营

联系电话：（021）38969999

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### （二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：缪建民

成立时间：1987年4月8日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83号

经营范围：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；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股

票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

（一）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，根据《基金合同》的约定对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

本基金主要投资于目标 ETF、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金、德国 DAX 指数成份股及备选成份股、跟踪德国 DAX 指数的股指期货等金融衍生品、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具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相关规定）。

本基金投资于目标 ETF 基金的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以相应将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制，不需经基金份额持有人大会审议。

本基金管理人自《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上述相关规定。

2、对基金投融资比例进行监督。基金托管人应自《基金合同》生效起对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应根据《基金合同》约定的监督基金合同约定的基金投资资产配置比例（自基金合同生效之日起满6个月后开始）、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规及《基金合同》规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人及时进行整改，整改的时限应符合法规及基金合同允许的投资比例调整期限。

#### 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）购买不动产；
- （5）购买房地产抵押按揭；
- （6）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （7）购买实物商品；
- （8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- （9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （10）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- （12）直接投资与实物商品相关的衍生品；
- （13）向基金管理人、基金托管人出资
- （14）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （15）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制，不需经基金份额持有人大会审议。

除非法律法规和监管部门禁止，本基金可以投资境外托管人发行的金融产品。

## 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。本款所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（2）基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

（3）基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或《基金合同》规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（4）基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受前述限制。

（5）基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

（6）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准。

（7）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。若基金超过上述（1）-（6）项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合投资比例限制要求。

由于本基金的申购赎回和目标 ETF 的申购赎回存在确认和交收时间上的差异，基金规模变动可能导致基金投资比例在短期内不符合基金合同的约定，此外，因证券市场波动、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟等因素也可能致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定，对于上述情形，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但因目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟致使不能在 10 个交易日内完成调整的，基金管理人应当在合理时间内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款约定的投资组合限制被修改或取消的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整投资限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

#### 金融衍生品投资

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

（1）基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

（2）基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

（3）基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

（4）基金拟投资衍生品，基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的风险管理流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

（5）基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（6）基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

#### 关于投资境外基金的限制

（1）每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞型基金的，该伞型基金应当视为一只基金。

（2）本基金不得投资于以下基金：

1) 其他基金中基金；

2) 联接基金（A Feeder Fund）；

3) 投资于前述两项基金的伞型基金子基金。



本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

1) 现金；

2) 存款证明；

3) 商业票据；

4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

3、基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《通知》及《基金合同》要求的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督；

4、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督，对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并通知基金管理人。

(1) 本基金的存款银行应是具有证券投资基金托管资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外基金投资人托管人资格的商业银行。

(2) 单只基金投资定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；存放在具有基金托管资格的同一银行存款不得超过基金资产净值的 30%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，基金公司履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。

(基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

1) 基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

2) 基金管理人负责控制流动性风险，并承担因控制不力而造成的损失。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足基金正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

3) 基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因基金管理人员的个人行为导致基金财产受到损失的，需由基金管理人承担由此造成的损失。

4) 基金管理人投资银行存款时，应就相关事宜在更新招募说明书中予以披露，进行风险揭示。

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

5、基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划拨、账目核对、到期兑付、提前支取和文件保管

#### (1) 基金投资银行存款协议的签订

1) 符合资格的存款银行，基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。

2) 基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法。

3) 由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称存款分支机构）寄送存款证实书或其他有效存款凭证的，基金管理人应在《存款协议书》中规定基金托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

4) 基金管理人应在《存款协议书》中规定，基金存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管帐户，并在《存款协议书》写明帐户名称和帐号，未划入指定帐户的，由存款银行承担一切责任。

5) 基金托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款证实书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

#### (2) 银行存款帐户的开设与管理

1) 基金投资于银行存款时，基金托管人应当依据基金管理人与存款银行签订的《总体合作协议》，以基金的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行帐户。

2) 银行存款的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

#### (3) 存款投资指令的发送与执行

1) 基金管理人发送投资指令应采用加密传真方式或双方约定的其他方式。

存款投资指令包括存款资金划拨指令、提前支取存款指令等。

基金管理人应按照法律法规和基金合同及托管协议的规定向基金托管人发送存款投资指令。对于基金管理人依约定程序发出的指令，基金管理人不得否认其效力。

指令发出后，基金管理人应及时以电话方式向基金托管人确认。

基金管理人在发送投资指令时，应为基金托管人执行投资指令留出执行指令所必需的时间。投资指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，导致资金未能及时到帐所造成的损失由基金管理人承担。

#### 2) 投资指令的确认

基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。投资指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容及印鉴和签名的表面一致性。

#### 3) 投资指令的执行

基金托管人验证投资指令后，应及时执行。

若因基金托管人过错致使资金未能及时到帐或者投资指令执行差错所造成的损失由基金托管人承担。投资指令执行完毕，基金托管人应及时通知基金管理人。

若基金托管人未能执行或仅可部分执行投资指令（无论因基金托管人原因还是基金管理人原因），基金托管人应及时电话通知基金管理人。

#### （4）资金划拨、账目核对及到期兑付

##### 1) 资金划拨

基金管理人的划拨指令，经基金托管人审核无误后应在规定期限内执行。存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。

##### 2) 存款证实书等存款凭证领取

存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证名称，该存款证实书为基金托管人存款确认或到期提款的有效凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥后，用特快专递将存款证实书原件寄送基金托管人指定联系人；若开户行代为保管存单的，由存款行分支机构指定会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥。”

##### 3) 存款证实书等存款凭证的遗失补办

存款证实书在邮寄过程中遗失的，由基金托管人向存款银行提出补办申请，基金管理人应督促存款银行尽快补办存款证实书或基金托管人兑付时可作为兑付依据的存款证明文件，并按以上（二）的方式特快专递给托管人。

##### 4) 账目核对

每个工作日，基金管理人应与基金托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

定期存款行负责于每个月的最后一个工作日提供加盖存款行公章的本基金存放在该机构的存款余额证明寄送至基金托管人指定联系人，并配合基金托管人招商银行股份有限公司对“存款证实书”的询证，并在询证函上加盖存款行公章寄送至基金托管人指定联系人。

##### 5) 到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过特快专递将存款证实书原件或其他存款证明原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款行未收到存款证实书原件的，应与基金托管人电话询问。存款到期前基金管理人与存款行确认存款证实书收到并于到期日兑付存款本息事宜。

基金托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不符时，通知基金管理人与存款行接洽存款到账时间及利息补付事宜。基金管理人应将接洽结果告知基金托管人，基金托管人收妥存款本息的当日通知基金管理人。

存款证实书在邮寄过程中遗失的，存款行应立即通知基金托管人，基金托管人在原存款证实书复印件上加盖公章并出具相关证明文件后，与存款行指定会计主管电话确认后，存款行分支机构应在到期日将存款本息划至指定基金账户。

如果存款到期日为法定节假日，存款行顺延至到期后第一个工作日支付，存款行需按当期利率和实际延期天数支付延期利息。

#### （5）提前支取

如果在存款期限内，由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要，经与定期存款行友好协商，基金管理人可以提前支取全部资金，但应继续按原有利率计提利息，因提前支取导致的利息损失应由基金管理人承担。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款行签订的《存款协议书》执行。

#### （6）银行存款相关文件的保管

1) 基金资金存入存款银行当日，存款行分支机构开具存款证实书或其他有效存款凭证，同时传真复印件给托管行和基金管理人，并寄送原件给托管人代为保管；若存款行代为保管存单原件，存款行传真复印件给托管行和基金管理人；

2) 存款证实书或其他有效存款凭证原件由基金托管人保管。

6、对法律法规规定及《基金合同》中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行监督。

II. 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，进行业务监督、核查。

III. 基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人 10 个工作日内纠正，投资组合比例的调整时间为 30 个工作日；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

IV. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：

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

V. 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，由基金托管人于估值日结束且相关数据齐备后，通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

VI. 基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人及其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

VII. 基金托管人对基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

## (二) 基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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

### 三、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产

3、基金托管人按照规定开设基金财产的所有资金账户和证券账户。

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

5、基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。

6、除依据有关法律法规规定和本协议约定外，基金托管人、及其境外托管人不得利用基金财产为自己或第三方谋取利益，违反此义务所得利益归于基金财产，由此造成的直接损失由基金托管人承担，该等责任包括但不限于恢复基金财产的原状、承担因此所引起的直接损失的赔偿责任。

7、基金托管人自身，并尽商业上的合理努力确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；

8、除非根据基金管理人书面同意，基金托管人不得在任何托管资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，基金托管人将尽商业上的合理努力确保境外托管人不得在任何托管资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，但根据有关适用法律的规定而产生的担保权利除外；

9、对于因为基金管理人进行本协议项下基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人。如因基金持有的资产所产生的应收资产，并由基金托管人作为资产持有人，基金托管人应负责与有关当事人确定到账日期并通知基金管理人。到账日没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知并配合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。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间募集的资金应当存入注册登记机构的备付金账户；该账户由注册登记机构管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合基金合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## （三）基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理，基金管理人应提供必要的协助。

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

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

4、基金银行账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

## （四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人或境外托管人在基金所投资市场的交易所或注册登记机构处按照该交易所或注册登记机构的业务规则开立证券账户，基金管理人应提供必要的协助。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自委托代理人均不得擅自出借转让基金的任何证券

账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件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。

4、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

#### （五）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或境外托管人负责开立，基金管理人应提供必要的协助。新账户按有关规则使用并管理。

2、投资市场所在国家或地区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。

#### （六）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人及其境外托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人及其境外托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人及其境外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及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （七）证券登记

1、境外证券的注册登记方式应符合投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例。

2、基金托管人应确保基金管理人所管理的基金或基金份额持有人始终是所有证券的实益所有人(beneficial owner)的方式持有基金财产中的所有证券。

3、基金托管人应该：(a)在其账目和记录中单独列记属于本基金的证券，并且(b)要求和尽商业上的合理努力确保其境外托管人在其账目和记录中单独清楚列记证券不属于境外托管人，不论证券以何人的名义登记。而且，若证券由基金托管人、境外托管人以无记名方式实际持有，要求和确保其境外托管人将这些证券和基金托管人、其境外托管人自有的资产、任何其他人的资产分别独立存放。

4、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法

性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

5、存放在证券系统的证券应按照基金托管人及其境外托管人的指示为基金的实益所有人持有，但须遵守管辖该系统运营的规则、条例和条件。

6、由基金托管人及其境外托管人为基金的利益而持有的证券（无记名证券和在证券系统持有的证券除外）应按本协议约定登记。

7、基金托管人及其境外托管人应就其为基金利益而持有证券的市场有关证券登记方式的重大改变通知基金管理人，并应基金管理人要求将这些市场发生的事件或惯例变化通知基金管理人。若基金管理人要求改变本协议约定的证券登记方式，基金托管人及其境外托管人应就此予以充分配合。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应及时将一份正本的原件或加盖公司印章的复印件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处，因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

### 四、基金资产净值计算与复核

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行，基金管理人可以委托第三方机构完成。基金托管人可委托境外托管人完成。

#### （一）基金资产净值的计算和复核

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。基金份额净值是指各类基金资产净值分别除以该类基金份额总数后的价值。各类基金份额净值的计算均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

##### 2、复核程序

基金管理人或其委托的第三方机构每个估值日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《企业会计准则》及其他法律法规的规定。每个工作日，基金管理人将前一工作日的基金估值结果发送给基金托管人。基金托管人应在收到后对净值计算结果进行复核，并在当日将复核结果发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。基金月末、季末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5、当任一类基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人、公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

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

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

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方

经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对各类基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人予以免责。基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）基金份额净值错误的处理方式

1、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出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

2、任一类基金份额净值计算差错小于该类基金份额净值 0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；当错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人、公告并报中国证监会备案。

3、关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### （1）差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、并不能克服的客观情况，按下列有关不可抗力的约定处理。

因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### （2）差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失，在基金管理人可承担的范围内应首先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿，本协议的当事人应将按照以下约定处理。

1) 如采用本协议或基金合同中估值方法进行处理，若基金管理人净值计算

出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成投资者损失的，由双方根据过错程度按照管理费和托管费的比例承担相应的责任；

2) 如基金管理人采用规定估值方法外的方法确定一个价格进行估值的情形并已告知基金托管人的情形下，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现或未提出异议，且造成投资者损失的，双方按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

3) 如基金管理人和基金托管人对任一类基金份额净值的计算结果不能达成一致时，为避免不能按时公布各类基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，基金管理人应在单方面对外公告基金净值计算结果时注明未经基金托管人复核，基金托管人有权将有关情况向监管机构报告，由此给投资者和基金造成的损失，由基金管理人承担赔偿责任，但因基金托管人故意或过失没有尽到复核义务的，基金托管人承担相应责任；

4) 如基金管理人未经基金托管人复核，单方面对外公告基金净值计算结果应该在公告上标明未经基金托管人复核。因基金管理人未经基金托管人复核而单方面对外公布的基金净值计算结果或公告的计算结果与基金托管人（最终）复核结果不一致而造成的损失，由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任；

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

6) 法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，基金管理人和基金托管人双方应本着平等和保护基金持有人利益的原则进行协商；

7) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

10) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

11) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿，但该第三方是由托管人委托的情况下，应由基金托管人负责赔偿并向差错方追偿。

12) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

13) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由

基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人任一类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### （三）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

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财产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护；

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、《基金合同》约定或中国证监会认定的其他情形。

### （四）基金会计核算

#### 1、基金账册的建立

基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人或其委托的境外托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。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。由此产生的后果基金托管人予以免责。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。

#### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人或其委托的境外托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

#### 3、基金托管人法定报告

基金托管人需根据相关法律法规的规定向监管机构报告相关信息，包括但不限于以下内容：



- (1) 自开设境外结算账户之日起 5 日内，将有关账户的详情报告外管局；
- (2) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关监管规定进行国际收支申报；
- (3) 发现基金管理人投资指令或资金汇出违法、违规的，及时向中国证监会或外管局报告；
- (4) 中国证监会和外管局规定的其他报告事项。

#### 4、基金财务报表和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；季度报告应在季度结束之日起 10 个工作日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 45 日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内，基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度终了后三个月内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告，中期报告或者年度报告。

基金管理人或其委托的第三方机构在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人或其委托的第三方机构的账

务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。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，由此产生的后果基金托管人予以免责。基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

### （三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应依法妥善保管基金份额持有人名册。基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本托管协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

## 六、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方

有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应各自继续履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 七、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的修改程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

### （三）基金财产的清算

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