

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招 募说明书（更新）

（二〇二二年第一号）

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

重要提示

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2019 年 9 月 30 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2019】1833 号《关于准予富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》）。本基金的基金合同于 2020 年 5 月 13 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景等做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金标的指数为中证 800 指数，指数简称中证 800。指数代码 000906。标的指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：<http://www.csindex.com.cn>。

本基金投资中的风险包括：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，大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购、赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、第三方机构服务的风险、资产支持证券的投资风险、金融衍生品投资风险、融资及转融通证券出借业务风险等等。本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

投资者投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所

基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证 800 指数成份股或备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证 800 指数成份股或备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

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

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照申请仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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

本招募说明书所载基金投资组合报告和基金业绩表现截止至 2021 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

本次招募说明书更新内容如下：

更新章节	更新内容
第三部分 基金管理人	更新基金管理人主要人员情况。
第十部分 基金份额的申购与赎回	更新申购、赎回清单的格式。

目录

第一部分 绪言	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 基金管理人.....	8
第四部分 基金托管人.....	20
第五部分 相关服务机构.....	25
第六部分 基金的募集.....	34
第七部分 基金合同的生效.....	35
第八部分 基金份额折算.....	36
第九部分 基金的上市交易.....	37
第十部分 基金份额的申购与赎回.....	40
第十一部分 基金的投资.....	73
第十二部分 基金的业绩.....	88
第十三部分 基金的财产.....	90
第十四部分 基金资产的估值.....	91
第十五部分 基金的收益与分配.....	97
第十六部分 基金费用与税收.....	99
第十七部分 基金的会计与审计.....	102
第十八部分 基金的信息披露.....	103
第十九部分 风险揭示.....	111
第二十部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	122
第二十一部分 基金合同的内容摘要.....	124
第二十二部分 基金托管协议的内容摘要.....	142

第二十三部分 对基金份额持有人的服务.....	158
第二十四部分 其他应披露事项.....	160
第二十五部分 招募说明书存放及其查阅方式.....	162
第二十六部分 备查文件.....	163

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定，以及《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指富国基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、上市交易公告书：指《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实

施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

16、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

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

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

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

24、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构

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

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

26、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

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

28、销售机构：指直销机构和代销机构

29、直销机构：指富国基金管理有限公司

30、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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

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

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

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

34、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

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

36、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

37、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，

基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

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

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

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

42、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

43、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n为自然数

44、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

45、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

46、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》（包括其不时修订），中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

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

48、申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

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

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

52、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同

和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

53、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证 800 指数及其未来可能发生的变更

54、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

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

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

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

58、预估现金部分：指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结

59、基金份额参考净值：指基金管理人或者基金管理人委托的机构根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所在交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

60、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为

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

62、元：指人民币元

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

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

65、基金份额净值增长率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

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

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

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

70、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

71、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

72、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介规定媒介规定报刊规定网站

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

74、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：富国基金管理有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

电话：（021）20361818

传真：（021）20361616

联系人：赵瑛

注册资本：5.2 亿元人民币

股权结构（截止于 2021 年 10 月 28 日）：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.78%
申万宏源证券有限公司	27.78%
加拿大蒙特利尔银行	27.78%
山东省国际信托股份有限公司	16.68%

二、主要人员情况

（一）董事会成员

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

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

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

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

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

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

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

张晓燕女士，董事，博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行（中国）有限公司首席风险官。历任美国加州理工学院化学系研究员，加拿大多伦多大学化学系助理教授，蒙特利尔银行企业操作风险部高级分析师、高级风险经理和部门总监，道明证券交易风险管理部副总裁兼总监，华侨银行全球风险管理部副总裁、市场风险管控及分析主管，新加坡交易所风险管理部高级副总裁和风险管理

主管。

王平先生，董事，硕士，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司首席财务官。历任山东鲁信实业集团公司计划财务部副经理、经理，山东鲁信投资集团股份有限公司、山东鲁信房地产投资开发有限公司财务部经理，鲁信创业投资集团股份有限公司财务总监，鲁信资本管理有限公司财务总监。

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

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

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

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

（二） 监事会成员

田志国先生，监事长，研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司首席风险官。历任山东省电子经济贸易中心综合部经理，山东省国际信托投资有限公

司稽核法律部项目经理，山东省国际信托有限公司信托五部项目经理、信托业务五部副总经理，山东省国际信托股份有限公司信托业务五部总经理。

曹志刚先生，监事，经济学硕士。现任海通证券股份有限公司稽核部副总经理，海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司监事，海通创意资本管理有限公司监事。历任海通证券股份有限公司风险控制总部（稽核部）二级部经理、稽核部总经理助理。

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

赵士毅先生，监事，本科学历。现任蒙特利尔银行（中国）有限公司董事总经理、亚洲企业投资发展部负责人。历任中国银联股份有限公司国际业务总部亚太业务发展业务主管，西班牙对外银行中国区执行董事、业务发展主管、中国区私人银行副总裁、中信-西班牙对外银行私人银行管理团队成员、亚洲零售银行助理副总裁、西班牙对外银行全球青年领导层培训生，上海复星高科技（集团）有限公司国际发展部执行总经理兼集团财富管理和私人银行委员会委员，蒙特利尔银行（中国）有限公司亚洲区战略发展总监。

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

孙玉礼先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司权益投资部资深基金专员。历任美世咨询数据中心数据分析师，韬睿惠悦管理咨询（深圳）有限公司福利部精算顾问，上海泽奔商务咨询有限公司咨询顾问，富国基金管理有限

公司高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理、基金专员。

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

黄奥博先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司战略与产品部副总经理兼产品二部总经理。历任国联安基金管理有限公司产品部产品经理助理，齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司产品部产品高级经理，富国基金管理有限公司产品经理、高级产品开发经理、资深产品开发经理、战略与产品部产品开发总监助理、战略与产品部产品副总监、战略与产品部产品总监。

（三）督察长

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

（四）经营管理层人员

陈戈先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

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

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

李笑薇女士，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家教委外资贷款办公室项目官员，摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCI BARRA）BARRA 股票风险评估部高级研究员，巴克莱国际投资管理公司（Barclays Global Investors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009年6月加入富国

基金管理有限公司，历任基金经理、量化与海外投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

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

（五）本基金基金经理

现任基金经理：

王乐乐，博士，曾任上海证券有限责任公司研究员，华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司研究员、创新规划团队负责人；自2015年5月加入富国基金管理有限公司，历任定量基金经理、量化投资部量化投资总监助理；现任富国基金量化投资部ETF投资总监兼高级定量基金经理。2015年8月至2020年1月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理，2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理，2017年10月至2020年1月任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年11月至2020年1月任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年11月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2018年12月至2020年5月任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年3月至2020年8月任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年6月至2020年8月任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年9月起任富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年10月起任富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月至2020年12月任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019年11月起任富国中证科技50策略交易型开放式指数证券投资基金、富国中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2019年12月起任富国中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年1月起任富国中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年2月起任富国中证科技50策略交易型开放式

指数证券投资基金联接基金基金经理；2020年3月起任富国中证医药50交易型开放式指数证券投资基金、富国中证消费50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020年5月起任富国中证800交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020年7月起任富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理，2021年5月起任富国中证800银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

（六）投资决策委员会成员

公司投委会成员：总经理陈戈，分管副总经理朱少醒，分管副总经理李笑薇。

（七）其他

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，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、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、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

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

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

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

- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- （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）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，

扰乱市场秩序；

- （10）贬损同行，以提高自己；
- （11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （12）以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；

(14) 其他法律、行政法规禁止的行为。

五、 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

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

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

六、 基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的风险管理和内部控制制度

1、风险管理体系

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

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

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

（2）识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在的原因。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

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

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

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

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

2、内部控制制度

（1）内部控制的原则

1) 全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

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

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

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

（2）内部控制的主要内容

1) 控制环境

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

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

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

2) 风险评估

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

3) 操作控制

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

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的

关系,以减少舞弊或差错发生的风险,各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

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

4) 信息与沟通

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

5) 监督与内部稽核

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

3、基金管理人关于内部控制的声明

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

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
成立时间：1984 年 1 月 1 日
法定代表人：陈四清
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

二、主要人员情况

截至 2021 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 214 人，平均年龄 34 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2021 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1215 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、

《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 78 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十四次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，

并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务

营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随

随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

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《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

第五部分 相关服务机构

一、基金销售机构

（一）直销机构

名称：富国基金管理有限公司

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

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

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

成立日期：1999 年 4 月 13 日

直销网点：直销中心

直销中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

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

传真：021-20513177

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

（二）场内申购、赎回代办证券公司

（1）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法人代表：黄炎勋

联系人员：陈剑虹

客服电话：400-800-1001

公司网站：www.essence.com.cn

（2）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址: 武汉新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表: 李新华

联系人员: 李良

客服电话: 95579 或 4008-888-999

公司网站: www.95579.com

(3) 第一创业证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法人代表: 刘学民

联系人员: 吴军

客服电话: 95358

公司网站: www.firstcapital.com.cn

(4) 东北证券股份有限公司

注册地址: 吉林省长春市南关区生态大街 6666 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法人代表: 李福春

联系人员: 安岩岩

客服电话: 95360

公司网站: www.nesc.cn

(5) 东吴证券股份有限公司

注册地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

法人代表: 范力

联系人员: 陆晓

客服电话: 95330

公司网站: www.dwzq.com.cn

(6) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

法人代表: 刘秋明

联系人员: 姚巍

客服电话: 95525

公司网站: www.ebscn.com

(7) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法人代表: 孙树明

联系人员: 黄岚

客服电话: 95575

公司网站: www.gf.com.cn

(8) 国联证券股份有限公司

注册地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦7-9层

办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702

法人代表: 姚志勇

联系人员: 沈刚

客服电话: 95570

公司网站: www.glsc.com.cn

(9) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区自由贸易试验区商城路618号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法人代表: 贺青

联系人员: 芮敏琪

客服电话: 400-8888-666/ 95521

公司网站: www.gtja.com

(10) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法人代表: 张纳沙

联系人员: 李颖

客服电话: 95536

公司网站: www.guosen.com.cn

(11)海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市广东路 689 号

法人代表: 周杰

联系人员: 李笑鸣

客服电话: 95553

公司网站: www.htsec.com

(12)恒泰证券股份有限公司

注册地址: 内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址: 内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法人代表: 庞介民

联系人员: 王旭华

客服电话: 956088

公司网站: www.cnht.com.cn

(13)华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

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

法人代表: 张伟

联系人员: 胡子豪

客服电话: 95597

公司网站: www.htsc.com.cn

(14)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

办公地址: 江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法人代表: 李剑锋

联系人员: 陈秀丛

客服电话: 4008-285-888

公司网站: www.njzq.com.cn

(15) 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法人代表: 何之江

联系人员: 吴琼

客服电话: 95511-8

公司网站: stock.pingan.com

(16) 申万宏源西部证券有限公司

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

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

法人代表: 王献军

联系人员: 李巍

客服电话: 4008-000-562

公司网站: www.hysec.com

(17) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法人代表: 杨玉成

联系人员: 黄莹

客服电话: 95523 或 4008895523

公司网站: www.swhysc.com

(18) 湘财证券股份有限公司

注册地址: 长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

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

法人代表: 高振营

联系人员: 江恩前

客服电话: 95351

公司网站: www.xcsc.com

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福建省福州市鼓楼区湖东路 268 号

办公地址: 浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法人代表: 杨华辉

联系人员: 夏中苏

客服电话: 95562

公司网站: www.xyzq.com.cn

(20) 浙商证券股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市五星路 201 号

办公地址: 浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6、7 楼

法人代表: 吴承根

联系人员: 张国放

客服电话: 4006-967777

公司网站: www.stocke.com.cn

(21) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法人代表: 陈共炎

联系人员: 辛国政

客服电话: 4008-888-888

公司网站: www.chinastock.com.cn

(22) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市经七路 86 号

办公地址: 济南市经七路 86 号 23 层

法人代表: 李峰

联系人员: 吴阳

客服电话: 95538

公司网站: www.qlzq.com.cn

(23) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法人代表: 王常青

联系人员: 权唐

客服电话: 400-8888-108

公司网站: www.csc108.com

(24) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

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

法人代表: 冯恩新

联系人员: 吴忠超

客服电话: 95548 或 400-889-5548

公司网站: www.zxzqsd.com.cn

(25) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 8 号中信证券大厦

法人代表: 张佑君

联系人员: 顾凌

客服电话: 95548 或 4008895548

公司网站: www.cs.ecitic.com

(26) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法人代表：胡伏云

联系人员：陈靖

客服电话：95396

公司网站：www.gzs.com.cn

(三) 二级市场交易代办证券公司

场内发售代理机构为具有代销业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

(四) 其他

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

二、 基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：（010）50938782

传真：（010）50938991

联系人：赵亦清

三、 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、徐莘

四、 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，已于 2019 年 9 月 30 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2019】1833 号《关于准予富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》）。

一、 基金运作方式

契约型，交易型开放式。

二、 基金类型

股票型证券投资基金。

三、 基金存续期限

不定期。

四、 募集情况

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效认购户数为 1,288 户，本次募集期的有效认购份额 248,517,814.00 份，利息结转的基金份额 8,278.00 份，两项合计共 248,526,092.00 份基金份额。募集期间基金管理人未运用固有资金认购本基金；募集期间基金管理人的从业人员未认购本基金。

五、 发行联接基金或增设新的份额类别

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，与基金托管人协商一致后，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，或为本基金增设新的份额类别，而无需召开基金份额持有人大会审议。

第七部分 基金合同的生效

一、 基金备案的条件

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

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

二、 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

三、 基金合同生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于2020年5月13日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

第八部分 基金份额折算

基金合同生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。

一、 基金份额折算的时间

基金管理人可根据实际需要确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

二、 基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除因小数点后的尾数处理外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

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

三、 基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金的上市交易

一、 基金份额的上市

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

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

二、 基金份额的上市交易

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

本基金已于 2020 年 5 月 29 日开始在上海证券交易所上市交易，详见基金管理人于 2020 年 5 月 26 日在基金管理人网站（www.fullgoal.com.cn）和《证券时报》发布的《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

三、 终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定提前终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

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

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交

易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式指数证券投资基金变更为以中证 800 指数为标的指数的非上市的开放式指数基金，且无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

四、 基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，并委托中证指数有限公司在相关证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV）并由上海证券交易所在交易时间内发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。参考净值的具体计算方法如下：

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购、赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

五、 在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，在履行适当程序后，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无须召开基金份额持有人大会审议。

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

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

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、 申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理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基金申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

在未来条件允许的情况下，基金管理人直销可以开通申购赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。

二、 申购和赎回的开放日及时间

1、 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

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

2、 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2020 年 5 月 29 日开始办理申购、赎回业务。

三、 申购与赎回的原则

1、 申购、赎回应遵守相关《业务规则》的规定。如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

2、 本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

3、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

4、申购、赎回申请提交后不得撤销。

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

四、 申购与赎回的程序

1、 申购和赎回的申请方式

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

投资者在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、 申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请不成立。

申购赎回代理券商受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

3、 申购与赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关《业务规则》和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

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

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

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

基金管理人、登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、 申购与赎回的数量限制

1、投资者申购、赎回的基金份额须为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位为 350 万份。

2、基金管理人可以规定本基金单日申购及赎回的上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

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

定在指定媒介上公告。

六、 申购和赎回的对价、费用及其用途

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

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。基金份额净值的计算公式为估值日基金资产净值除以估值日发售在外的基金份额总数，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

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

七、 申购、赎回清单的内容与格式

1、 申购赎回清单的内容

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

2、 组合证券相关内容

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

3、 现金替代相关内容

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

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

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

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

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

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

(2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于中证 800 指数中的上海证券交易所上市的成份股。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 申购现金替代溢价比例)

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

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

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

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 N+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。N+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 N+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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

若现金替代日（T 日）后至 N+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

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

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

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

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所证券参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的证券参考价格为准。基金份额参考净值目前为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所基金份额参考净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的基金份额参考净值为准。

（3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除，或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后 T 日开盘参考价。

（4）退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证 800 指数深圳证券交易所上市的成份股；

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

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

③替代金额的处理程序

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

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

向投资者收取多支付的差额。

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

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 N+2 日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上海证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

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

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

N+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 N+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

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

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

N+2 日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

4、预估现金部分相关内容

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

预估现金部分的计算公式为：

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

其中，该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份股的调整后开盘参考价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则

计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

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

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

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

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2022/XX/XX
基金名称	富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	富国基金管理有限公司
基金代码	515820

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	219,882.83
最小申购、赎回单位净值（单位：元）	4,660,199.83
基金份额净值（单位：元）	1.3315

T 日信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分 (单位: 元)	213,315.83
现金替代比例上限	50%
申购上限	无
赎回上限	20000000
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位 (单位: 份)	3500000
申购赎回的允许情况	申购和赎回皆允许

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量 (股)	现金替代标志	申购现金 替代溢价 比率	赎回现金替 代折价比率	替代金额 (单位: 人民币 元)
000001	平安银行	1600	深市退补	10%	20%	23856
000002	万科 A	1100	深市退补	10%	20%	22044
000009	中国宝安	400	深市退补	10%	20%	5496
000012	南 玻 A	200	深市退补	10%	20%	1468
000021	深科技	200	深市退补	10%	20%	2234
000027	深圳能源	300	深市退补	10%	20%	2040
000028	国药一致	0	深市必须	-	-	0
000031	大悦城	200	深市退补	10%	20%	768
000039	中集集团	200	深市退补	10%	20%	2760
000050	深天马 A	200	深市退补	10%	20%	1934
000060	中金岭南	400	深市退补	10%	20%	1788
000062	深圳华强	100	深市退补	10%	20%	1213
000063	中兴通讯	500	深市退补	10%	20%	12440
000066	中国长城	300	深市退补	10%	20%	3078
000069	华侨城 A	700	深市退补	10%	20%	4158
000089	深圳机场	200	深市退补	10%	20%	1442
000100	TCL 科技	2400	深市退补	10%	20%	11256
000156	华数传媒	200	深市退补	10%	20%	1546
000157	中联重科	800	深市退补	10%	20%	5072
000158	常山北明	200	深市退补	10%	20%	1196
000166	申万宏源	1500	深市退补	10%	20%	6300
000301	东方盛虹	300	深市退补	10%	20%	5097

000333	美的集团	800	深市退补	10%	20%	47632
000338	潍柴动力	900	深市退补	10%	20%	11187
000400	许继电气	100	深市退补	10%	20%	1966
000401	冀东水泥	200	深市退补	10%	20%	2072
000402	金融街	200	深市退补	10%	20%	1188
000408	藏格矿业	100	深市退补	10%	20%	3736
000415	渤海租赁	400	深市退补	10%	20%	888
000425	徐工机械	900	深市退补	10%	20%	4941
000488	晨鸣纸业	200	深市退补	10%	20%	1116
000513	丽珠集团	100	深市退补	10%	20%	3643
000519	中兵红箭	100	深市退补	10%	20%	3257
000528	柳工	200	深市退补	10%	20%	1314
000537	广宇发展	100	深市退补	10%	20%	1280
000538	云南白药	100	深市退补	10%	20%	6084
000540	中天金融	700	深市退补	10%	20%	1330
000547	航天发展	200	深市退补	10%	20%	2470
000553	安道麦 A	100	深市退补	10%	20%	1261
000559	万向钱潮	200	深市退补	10%	20%	1162
000563	陕国投 A	300	深市退补	10%	20%	921
000568	泸州老窖	100	深市退补	10%	20%	24400
000581	威孚高科	100	深市退补	10%	20%	1919
000596	古井贡酒	0	深市必须	-	-	0
000598	兴蓉环境	300	深市退补	10%	20%	1575
000623	吉林敖东	200	深市退补	10%	20%	2914
000625	长安汽车	800	深市退补	10%	20%	13736
000629	攀钢钒钛	700	深市退补	10%	20%	3542
000630	铜陵有色	1200	深市退补	10%	20%	3972
000636	风华高科	100	深市退补	10%	20%	1796
000651	格力电器	800	深市退补	10%	20%	26536
000656	金科股份	600	深市退补	10%	20%	1674
000661	长春高新	100	深市退补	10%	20%	23423
000671	阳光城	400	深市退补	10%	20%	856
000685	中山公用	200	深市退补	10%	20%	1556
000686	东北证券	200	深市退补	10%	20%	1362
000690	宝新能源	400	深市退补	10%	20%	1868
000703	恒逸石化	400	深市退补	10%	20%	4244
000708	中信特钢	200	深市退补	10%	20%	4014
000709	河钢股份	700	深市退补	10%	20%	1813
000717	韶钢松山	200	深市退补	10%	20%	708
000718	苏宁环球	300	深市退补	10%	20%	1044
000725	京东方 A	6300	深市退补	10%	20%	24318
000728	国元证券	400	深市退补	10%	20%	2436

000729	燕京啤酒	200	深市退补	10%	20%	1910
000738	航发控制	100	深市退补	10%	20%	2889
000739	普洛药业	100	深市退补	10%	20%	2181
000750	国海证券	600	深市退补	10%	20%	2130
000768	中航西飞	200	深市退补	10%	20%	6206
000776	广发证券	500	深市退补	10%	20%	8890
000778	新兴铸管	400	深市退补	10%	20%	1980
000783	长江证券	600	深市退补	10%	20%	3534
000785	居然之家	300	深市退补	10%	20%	1260
000786	北新建材	200	深市退补	10%	20%	6744
000792	盐湖股份	700	深市退补	10%	20%	22540
000800	一汽解放	200	深市退补	10%	20%	1818
000807	云铝股份	300	深市退补	10%	20%	3135
000825	太钢不锈	400	深市退补	10%	20%	2228
000830	鲁西化工	200	深市退补	10%	20%	3586
000831	五矿稀土	100	深市退补	10%	20%	3057
000858	五粮液	300	深市退补	10%	20%	59583
000869	张裕A	0	深市必须	-	-	0
000876	新希望	400	深市退补	10%	20%	6944
000877	天山股份	100	深市退补	10%	20%	1264
000878	云南铜业	200	深市退补	10%	20%	2296
000883	湖北能源	300	深市退补	10%	20%	1563
000887	中鼎股份	100	深市退补	10%	20%	1842
000895	双汇发展	300	深市退补	10%	20%	8946
000898	鞍钢股份	400	深市退补	10%	20%	1304
000930	中粮科技	200	深市退补	10%	20%	1824
000932	华菱钢铁	700	深市退补	10%	20%	3689
000937	冀中能源	200	深市退补	10%	20%	1516
000938	紫光股份	200	深市退补	10%	20%	3940
000959	首钢股份	300	深市退补	10%	20%	1485
000960	锡业股份	200	深市退补	10%	20%	3406
000961	中南建设	300	深市退补	10%	20%	897
000963	华东医药	100	深市退补	10%	20%	4752
000967	盈峰环境	200	深市退补	10%	20%	1018
000970	中科三环	200	深市退补	10%	20%	3698
000975	银泰黄金	300	深市退补	10%	20%	2910
000977	浪潮信息	200	深市退补	10%	20%	5170
000983	山西焦煤	300	深市退补	10%	20%	4158
000987	越秀金控	300	深市退补	10%	20%	2013
000988	华工科技	200	深市退补	10%	20%	4580
000990	诚志股份	100	深市退补	10%	20%	1068
000997	新大陆	100	深市退补	10%	20%	1294

000998	隆平高科	200	深市退补	10%	20%	3336
000999	华润三九	100	深市退补	10%	20%	4586
001203	大中矿业	0	深市必须	-	-	0
001227	兰州银行	100	深市退补	10%	20%	482
001289	龙源电力	0	深市必须	-	-	0
001872	招商港口	0	深市必须	-	-	0
001914	招商积余	100	深市退补	10%	20%	1774
001965	招商公路	100	深市退补	10%	20%	744
001979	招商蛇口	500	深市退补	10%	20%	6555
002001	新和成	300	深市退补	10%	20%	6858
002002	鸿达兴业	400	深市退补	10%	20%	1444
002004	华邦健康	300	深市退补	10%	20%	1671
002007	华兰生物	200	深市退补	10%	20%	4784
002008	大族激光	100	深市退补	10%	20%	3161
002010	传化智联	200	深市退补	10%	20%	1244
002019	亿帆医药	100	深市退补	10%	20%	1438
002027	分众传媒	1700	深市退补	10%	20%	11509
002028	思源电气	100	深市退补	10%	20%	3810
002030	达安基因	200	深市退补	10%	20%	3530
002032	苏泊尔	0	深市必须	-	-	0
002048	宁波华翔	100	深市退补	10%	20%	1573
002049	紫光国微	100	深市退补	10%	20%	20956
002050	三花智控	300	深市退补	10%	20%	8367
002056	横店东磁	100	深市退补	10%	20%	2529
002064	华峰化学	200	深市退补	10%	20%	1720
002065	东华软件	400	深市退补	10%	20%	2444
002074	国轩高科	200	深市退补	10%	20%	9210
002078	太阳纸业	300	深市退补	10%	20%	3606
002081	金螳螂	200	深市退补	10%	20%	1014
002092	中泰化学	400	深市退补	10%	20%	3196
002110	三钢闽光	200	深市退补	10%	20%	1234
002120	韵达股份	200	深市退补	10%	20%	3446
002124	天邦食品	300	深市退补	10%	20%	2286
002127	南极电商	300	深市退补	10%	20%	1587
002128	电投能源	100	深市退补	10%	20%	1529
002129	TCL 中环	400	深市退补	10%	20%	24356
002131	利欧股份	1100	深市退补	10%	20%	2112
002138	顺络电子	100	深市退补	10%	20%	2450
002142	宁波银行	700	深市退补	10%	20%	24605
002146	荣盛发展	400	深市退补	10%	20%	1168
002152	广电运通	200	深市退补	10%	20%	1826
002153	石基信息	100	深市退补	10%	20%	1477

002155	湖南黄金	100	深市退补	10%	20%	1196
002156	通富微电	200	深市退补	10%	20%	2976
002174	游族网络	100	深市退补	10%	20%	965
002179	中航光电	100	深市退补	10%	20%	6458
002180	纳思达	100	深市退补	10%	20%	5153
002183	怡亚通	300	深市退补	10%	20%	2106
002185	华天科技	400	深市退补	10%	20%	3632
002191	劲嘉股份	200	深市退补	10%	20%	1950
002195	二三四五	1000	深市退补	10%	20%	2190
002202	金风科技	500	深市退补	10%	20%	7585
002203	海亮股份	200	深市退补	10%	20%	2334
002212	天融信	200	深市退补	10%	20%	1970
002221	东华能源	200	深市退补	10%	20%	1902
002223	鱼跃医疗	100	深市退补	10%	20%	2670
002230	科大讯飞	300	深市退补	10%	20%	13191
002233	塔牌集团	100	深市退补	10%	20%	878
002236	大华股份	300	深市退补	10%	20%	4845
002240	盛新锂能	100	深市退补	10%	20%	6925
002241	歌尔股份	400	深市退补	10%	20%	12944
002242	九阳股份	100	深市退补	10%	20%	1870
002244	滨江集团	200	深市退补	10%	20%	1822
002249	大洋电机	300	深市退补	10%	20%	1839
002250	联化科技	100	深市退补	10%	20%	1711
002252	上海莱士	700	深市退补	10%	20%	4242
002266	浙富控股	400	深市退补	10%	20%	1924
002268	卫士通	100	深市退补	10%	20%	4398
002271	东方雨虹	300	深市退补	10%	20%	13989
002273	水晶光电	200	深市退补	10%	20%	2400
002281	光迅科技	100	深市退补	10%	20%	1697
002294	信立泰	100	深市退补	10%	20%	2777
002299	圣农发展	100	深市退补	10%	20%	1928
002304	洋河股份	100	深市退补	10%	20%	18250
002311	海大集团	100	深市退补	10%	20%	6122
002326	永太科技	100	深市退补	10%	20%	3382
002352	顺丰控股	300	深市退补	10%	20%	16932
002353	杰瑞股份	100	深市退补	10%	20%	3987
002368	太极股份	100	深市退补	10%	20%	1854
002371	北方华创	0	深市必须	-	-	0
002372	伟星新材	100	深市退补	10%	20%	2295
002373	千方科技	200	深市退补	10%	20%	2022
002382	蓝帆医疗	100	深市退补	10%	20%	952
002384	东山精密	200	深市退补	10%	20%	4322

002385	大北农	600	深市退补	10%	20%	4788
002387	维信诺	200	深市退补	10%	20%	1244
002390	信邦制药	200	深市退补	10%	20%	1348
002396	星网锐捷	100	深市退补	10%	20%	2208
002399	海普瑞	100	深市退补	10%	20%	1746
002407	多氟多	100	深市退补	10%	20%	5382
002408	齐翔腾达	300	深市退补	10%	20%	2415
002409	雅克科技	0	深市必须	-	-	0
002410	广联达	200	深市退补	10%	20%	10696
002414	高德红外	200	深市退补	10%	20%	2524
002415	海康威视	800	深市退补	10%	20%	29032
002416	爱施德	100	深市退补	10%	20%	915
002422	科伦药业	200	深市退补	10%	20%	3868
002423	中粮资本	200	深市退补	10%	20%	1332
002429	兆驰股份	400	深市退补	10%	20%	1500
002430	杭氧股份	100	深市退补	10%	20%	3106
002434	万里扬	100	深市退补	10%	20%	872
002439	启明星辰	100	深市退补	10%	20%	2035
002444	巨星科技	100	深市退补	10%	20%	1897
002459	晶澳科技	200	深市退补	10%	20%	15000
002460	赣锋锂业	200	深市退补	10%	20%	21970
002465	海格通信	300	深市退补	10%	20%	2688
002466	天齐锂业	200	深市退补	10%	20%	29434
002468	申通快递	100	深市退补	10%	20%	1200
002475	立讯精密	800	深市退补	10%	20%	24888
002493	荣盛石化	500	深市退补	10%	20%	7615
002497	雅化集团	200	深市退补	10%	20%	6968
002500	山西证券	400	深市退补	10%	20%	2220
002505	鹏都农牧	500	深市退补	10%	20%	1780
002506	协鑫集成	700	深市退补	10%	20%	2653
002507	涪陵榨菜	100	深市退补	10%	20%	3367
002508	老板电器	100	深市退补	10%	20%	3428
002511	中顺洁柔	100	深市退补	10%	20%	1241
002532	天山铝业	200	深市退补	10%	20%	1326
002555	三七互娱	200	深市退补	10%	20%	4084
002557	洽洽食品	100	深市退补	10%	20%	5365
002563	森马服饰	100	深市退补	10%	20%	606
002568	百润股份	100	深市退补	10%	20%	3183
002572	索菲亚	100	深市退补	10%	20%	2552
002594	比亚迪	200	深市退补	10%	20%	66778
002595	豪迈科技	100	深市退补	10%	20%	2251
002600	领益智造	500	深市退补	10%	20%	2475

002601	龙佰集团	200	深市退补	10%	20%	4264
002602	世纪华通	800	深市退补	10%	20%	3800
002603	以岭药业	100	深市退补	10%	20%	2500
002607	中公教育	300	深市退补	10%	20%	1731
002624	完美世界	200	深市退补	10%	20%	2762
002625	光启技术	200	深市退补	10%	20%	3510
002648	卫星化学	200	深市退补	10%	20%	5228
002653	海思科	0	深市必须	-	-	0
002670	国盛金控	200	深市必须	-	-	1920
002673	西部证券	500	深市退补	10%	20%	3230
002683	广东宏大	100	深市退补	10%	20%	2998
002690	美亚光电	100	深市退补	10%	20%	2182
002701	奥瑞金	300	深市退补	10%	20%	1545
002705	新宝股份	100	深市退补	10%	20%	2188
002709	天赐材料	200	深市退补	10%	20%	13350
002714	牧原股份	400	深市退补	10%	20%	25400
002736	国信证券	500	深市退补	10%	20%	4705
002739	万达电影	200	深市退补	10%	20%	2626
002745	木林森	200	深市退补	10%	20%	1924
002756	永兴材料	0	深市必须	-	-	0
002791	坚朗五金	0	深市必须	-	-	0
002797	第一创业	600	深市退补	10%	20%	3756
002812	恩捷股份	100	深市退补	10%	20%	25607
002815	崇达技术	100	深市退补	10%	20%	1250
002821	凯莱英	0	深市必须	-	-	0
002831	裕同科技	100	深市退补	10%	20%	2888
002841	视源股份	100	深市退补	10%	20%	7300
002867	周大生	100	深市退补	10%	20%	1494
002901	大博医疗	0	深市必须	-	-	0
002916	深南电路	0	深市必须	-	-	0
002920	德赛西威	0	深市必须	-	-	0
002925	盈趣科技	100	深市退补	10%	20%	2070
002926	华西证券	300	深市退补	10%	20%	2277
002936	郑州银行	900	深市退补	10%	20%	2394
002938	鹏鼎控股	100	深市退补	10%	20%	2862
002939	长城证券	200	深市退补	10%	20%	1990
002945	华林证券	0	深市必须	-	-	0
002946	新乳业	0	深市必须	-	-	0
002948	青岛银行	300	深市退补	10%	20%	1074
002958	青农商行	700	深市退补	10%	20%	2303
002966	苏州银行	300	深市退补	10%	20%	1827
002985	北摩高科	0	深市必须	-	-	0

003035	南网能源	200	深市退补	10%	20%	1308
003816	中国广核	2000	深市退补	10%	20%	5800
300001	特锐德	100	深市退补	10%	20%	1758
300003	乐普医疗	200	深市退补	10%	20%	3774
300009	安科生物	200	深市退补	10%	20%	2068
300012	华测检测	300	深市退补	10%	20%	6636
300014	亿纬锂能	200	深市退补	10%	20%	18880
300015	爱尔眼科	500	深市退补	10%	20%	22325
300017	网宿科技	400	深市退补	10%	20%	2076
300024	机器人	200	深市退补	10%	20%	1950
300026	红日药业	300	深市退补	10%	20%	2271
300033	同花顺	0	深市必须	-	-	0
300037	新宙邦	100	深市退补	10%	20%	5474
300058	蓝色光标	400	深市退补	10%	20%	2456
300059	东方财富	1800	深市退补	10%	20%	45414
300070	碧水源	400	深市退补	10%	20%	2036
300072	三聚环保	300	深市退补	10%	20%	1575
300073	当升科技	100	深市退补	10%	20%	10496
300088	长信科技	400	深市退补	10%	20%	2824
300115	长盈精密	100	深市退补	10%	20%	991
300122	智飞生物	100	深市退补	10%	20%	11993
300124	汇川技术	300	深市退补	10%	20%	19407
300136	信维通信	200	深市退补	10%	20%	3356
300142	沃森生物	300	深市退补	10%	20%	15027
300144	宋城演艺	300	深市退补	10%	20%	4320
300146	汤臣倍健	200	深市退补	10%	20%	4330
300166	东方国信	200	深市退补	10%	20%	1766
300168	万达信息	200	深市退补	10%	20%	1812
300182	捷成股份	400	深市退补	10%	20%	2072
300207	欣旺达	200	深市退补	10%	20%	6080
300212	易华录	100	深市退补	10%	20%	1691
300223	北京君正	0	深市必须	-	-	0
300244	迪安诊断	100	深市退补	10%	20%	3177
300251	光线传媒	200	深市退补	10%	20%	1792
300253	卫宁健康	300	深市退补	10%	20%	2634
300257	开山股份	100	深市退补	10%	20%	1511
300274	阳光电源	200	深市退补	10%	20%	17586
300285	国瓷材料	100	深市退补	10%	20%	3437
300296	利亚德	300	深市退补	10%	20%	2061
300308	中际旭创	100	深市退补	10%	20%	3074
300316	晶盛机电	100	深市退补	10%	20%	6899
300347	泰格医药	100	深市退补	10%	20%	12651

300357	我武生物	100	深市退补	10%	20%	5272
300363	博腾股份	100	深市退补	10%	20%	8546
300376	易事特	200	深市退补	10%	20%	1570
300383	光环新网	200	深市退补	10%	20%	2000
300390	天华超净	100	深市退补	10%	20%	9542
300408	三环集团	200	深市退补	10%	20%	5544
300413	芒果超媒	100	深市退补	10%	20%	3188
300418	昆仑万维	200	深市退补	10%	20%	3084
300433	蓝思科技	300	深市退补	10%	20%	3261
300450	先导智能	200	深市退补	10%	20%	12540
300454	深信服	0	深市必须	-	-	0
300463	迈克生物	100	深市退补	10%	20%	2140
300474	景嘉微	0	深市必须	-	-	0
300482	万孚生物	0	深市必须	-	-	0
300496	中科创达	100	深市退补	10%	20%	13195
300498	温氏股份	900	深市退补	10%	20%	22005
300529	健帆生物	100	深市退补	10%	20%	5060
300558	贝达药业	0	深市必须	-	-	0
300595	欧普康视	100	深市退补	10%	20%	5360
300601	康泰生物	100	深市退补	10%	20%	4573
300618	寒锐钴业	0	深市必须	-	-	0
300628	亿联网络	100	深市退补	10%	20%	7249
300630	普利制药	0	深市必须	-	-	0
300661	圣邦股份	0	深市必须	-	-	0
300676	华大基因	0	深市必须	-	-	0
300677	英科医疗	100	深市退补	10%	20%	2532
300699	光威复材	100	深市退补	10%	20%	6078
300724	捷佳伟创	0	深市必须	-	-	0
300741	华宝股份	0	深市必须	-	-	0
300750	宁德时代	200	深市退补	10%	20%	104774
300751	迈为股份	0	深市必须	-	-	0
300759	康龙化成	100	深市退补	10%	20%	10700
300760	迈瑞医疗	100	深市退补	10%	20%	33540
300763	锦浪科技	0	深市必须	-	-	0
300769	德方纳米	0	深市必须	-	-	0
300782	卓胜微	100	深市退补	10%	20%	13105
300832	新产业	100	深市退补	10%	20%	4549
300866	安克创新	0	深市必须	-	-	0
300869	康泰医学	0	深市必须	-	-	0
300888	稳健医疗	0	深市必须	-	-	0
300896	爱美客	0	深市必须	-	-	0
300919	中伟股份	0	深市必须	-	-	0

300957	贝泰妮	0	深市必须	-	-	0
300979	华利集团	0	深市必须	-	-	0
300999	金龙鱼	100	深市退补	10%	20%	5409
600000	浦发银行	2000	允许	10%	0%	-
600006	东风汽车	100	允许	10%	0%	-
600008	首创环保	700	允许	10%	0%	-
600009	上海机场	200	允许	10%	0%	-
600010	包钢股份	3800	允许	10%	0%	-
600011	华能国际	700	允许	10%	0%	-
600015	华夏银行	1000	允许	10%	0%	-
600016	民生银行	4200	允许	10%	0%	-
600018	上港集团	600	允许	10%	0%	-
600019	宝钢股份	1500	允许	10%	0%	-
600021	上海电力	200	允许	10%	0%	-
600022	山东钢铁	900	允许	10%	0%	-
600025	华能水电	300	允许	10%	0%	-
600026	中远海能	200	允许	10%	0%	-
600027	华电国际	600	允许	10%	0%	-
600028	中国石化	2300	允许	10%	0%	-
600029	南方航空	900	允许	10%	0%	-
600030	中信证券	1600	允许	10%	0%	-
600031	三一重工	1000	允许	10%	0%	-
600036	招商银行	2100	允许	10%	0%	-
600037	歌华有线	200	允许	10%	0%	-
600038	中直股份	100	允许	10%	0%	-
600039	四川路桥	300	允许	10%	0%	-
600048	保利发展	1200	允许	10%	0%	-
600050	中国联通	3100	允许	10%	0%	-
600056	中国医药	100	允许	10%	0%	-
600060	海信视像	100	允许	10%	0%	-
600061	国投资本	400	允许	10%	0%	-
600062	华润双鹤	100	允许	10%	0%	-
600064	南京高科	100	允许	10%	0%	-
600066	宇通客车	200	允许	10%	0%	-
600079	人福医药	200	允许	10%	0%	-
600085	同仁堂	100	允许	10%	0%	-
600089	特变电工	600	允许	10%	0%	-
600095	湘财股份	100	允许	10%	0%	-
600096	云天化	200	允许	10%	0%	-
600104	上汽集团	800	允许	10%	0%	-
600109	国金证券	400	允许	10%	0%	-
600111	北方稀土	400	允许	10%	0%	-

600115	中国东航	900	允许	10%	0%	-
600118	中国卫星	100	允许	10%	0%	-
600120	浙江东方	300	允许	10%	0%	-
600126	杭钢股份	200	允许	10%	0%	-
600131	国网信通	100	允许	10%	0%	-
600132	重庆啤酒	0	必须	-	-	0
600141	兴发集团	100	允许	10%	0%	-
600143	金发科技	300	允许	10%	0%	-
600150	中国船舶	300	允许	10%	0%	-
600153	建发股份	300	允许	10%	0%	-
600155	华创阳安	200	允许	10%	0%	-
600157	永泰能源	3700	允许	10%	0%	-
600160	巨化股份	200	允许	10%	0%	-
600161	天坛生物	100	允许	10%	0%	-
600166	福田汽车	800	允许	10%	0%	-
600167	联美控股	200	允许	10%	0%	-
600170	上海建工	900	允许	10%	0%	-
600171	上海贝岭	100	允许	10%	0%	-
600176	中国巨石	400	允许	10%	0%	-
600177	雅戈尔	500	允许	10%	0%	-
600183	生益科技	200	允许	10%	0%	-
600188	兖矿能源	200	允许	10%	0%	-
600195	中牧股份	100	允许	10%	0%	-
600196	复星医药	200	允许	10%	0%	-
600201	生物股份	200	允许	10%	0%	-
600208	新湖中宝	700	允许	10%	0%	-
600216	浙江医药	100	允许	10%	0%	-
600219	南山铝业	1200	允许	10%	0%	-
600233	圆通速递	200	允许	10%	0%	-
600236	桂冠电力	400	允许	10%	0%	-
600256	广汇能源	800	允许	10%	0%	-
600258	首旅酒店	100	允许	10%	0%	-
600259	广晟有色	0	必须	-	-	0
600271	航天信息	200	允许	10%	0%	-
600276	恒瑞医药	800	允许	10%	0%	-
600282	南钢股份	500	允许	10%	0%	-
600297	广汇汽车	700	允许	10%	0%	-
600298	安琪酵母	100	允许	10%	0%	-
600299	安迪苏	100	允许	10%	0%	-
600307	酒钢宏兴	500	允许	10%	0%	-
600309	万华化学	300	允许	10%	0%	-
600315	上海家化	100	允许	10%	0%	-

600316	洪都航空	100	允许	10%	0%	-
600325	华发股份	300	允许	10%	0%	-
600329	达仁堂	0	必须	-	-	0
600332	白云山	100	允许	10%	0%	-
600339	中油工程	300	允许	10%	0%	-
600346	恒力石化	400	允许	10%	0%	-
600348	华阳股份	200	允许	10%	0%	-
600350	山东高速	100	允许	10%	0%	-
600352	浙江龙盛	400	允许	10%	0%	-
600362	江西铜业	200	允许	10%	0%	-
600369	西南证券	600	允许	10%	0%	-
600372	中航电子	100	允许	10%	0%	-
600373	中文传媒	100	允许	10%	0%	-
600376	首开股份	200	允许	10%	0%	-
600377	宁沪高速	100	允许	10%	0%	-
600380	健康元	200	允许	10%	0%	-
600383	金地集团	500	允许	10%	0%	-
600390	五矿资本	400	允许	10%	0%	-
600392	盛和资源	200	允许	10%	0%	-
600398	海澜之家	300	允许	10%	0%	-
600399	抚顺特钢	300	允许	10%	0%	-
600406	国电南瑞	600	允许	10%	0%	-
600409	三友化工	200	允许	10%	0%	-
600415	小商品城	500	允许	10%	0%	-
600418	江淮汽车	300	允许	10%	0%	-
600426	华鲁恒升	300	允许	10%	0%	-
600435	北方导航	100	允许	10%	0%	-
600436	片仔癀	100	允许	10%	0%	-
600438	通威股份	500	允许	10%	0%	-
600446	金证股份	100	允许	10%	0%	-
600460	士兰微	100	允许	10%	0%	-
600482	中国动力	200	允许	10%	0%	-
600486	扬农化工	0	必须	-	-	0
600487	亨通光电	300	允许	10%	0%	-
600489	中金黄金	500	允许	10%	0%	-
600497	驰宏锌锗	600	允许	10%	0%	-
600498	烽火通信	100	允许	10%	0%	-
600499	科达制造	200	允许	10%	0%	-
600500	中化国际	200	允许	10%	0%	-
600507	方大特钢	200	允许	10%	0%	-
600511	国药股份	100	允许	10%	0%	-
600516	方大炭素	400	允许	10%	0%	-

600517	国网英大	300	允许	10%	0%	-
600519	贵州茅台	100	允许	10%	0%	-
600521	华海药业	200	允许	10%	0%	-
600522	中天科技	500	允许	10%	0%	-
600528	中铁工业	200	允许	10%	0%	-
600529	山东药玻	100	允许	10%	0%	-
600535	天士力	200	允许	10%	0%	-
600536	中国软件	100	允许	10%	0%	-
600546	山煤国际	200	允许	10%	0%	-
600547	山东黄金	300	允许	10%	0%	-
600549	厦门钨业	100	允许	10%	0%	-
600556	天下秀	200	允许	10%	0%	-
600563	法拉电子	0	必须	-	-	0
600566	济川药业	100	允许	10%	0%	-
600567	山鹰国际	500	允许	10%	0%	-
600570	恒生电子	200	允许	10%	0%	-
600572	康恩贝	300	允许	10%	0%	-
600580	卧龙电驱	200	允许	10%	0%	-
600582	天地科技	300	允许	10%	0%	-
600584	长电科技	200	允许	10%	0%	-
600585	海螺水泥	400	允许	10%	0%	-
600588	用友网络	300	允许	10%	0%	-
600597	光明乳业	100	允许	10%	0%	-
600598	北大荒	100	允许	10%	0%	-
600600	青岛啤酒	100	允许	10%	0%	-
600606	绿地控股	600	允许	10%	0%	-
600623	华谊集团	100	允许	10%	0%	-
600637	东方明珠	300	允许	10%	0%	-
600642	申能股份	400	允许	10%	0%	-
600648	外高桥	100	允许	10%	0%	-
600655	豫园股份	300	允许	10%	0%	-
600660	福耀玻璃	300	允许	10%	0%	-
600663	陆家嘴	100	允许	10%	0%	-
600667	太极实业	200	允许	10%	0%	-
600673	东阳光	300	允许	10%	0%	-
600690	海尔智家	600	允许	10%	0%	-
600699	均胜电子	200	允许	10%	0%	-
600704	物产中大	500	允许	10%	0%	-
600705	中航产融	900	允许	10%	0%	-
600707	彩虹股份	200	允许	10%	0%	-
600717	天津港	200	允许	10%	0%	-
600718	东软集团	100	允许	10%	0%	-

600728	佳都科技	200	允许	10%	0%	-
600732	爱旭股份	100	允许	10%	0%	-
600737	中粮糖业	200	允许	10%	0%	-
600739	辽宁成大	200	允许	10%	0%	-
600741	华域汽车	300	允许	10%	0%	-
600745	闻泰科技	100	允许	10%	0%	-
600755	厦门国贸	200	允许	10%	0%	-
600760	中航沈飞	100	允许	10%	0%	-
600763	通策医疗	0	必须	-	-	0
600764	中国海防	0	必须	-	-	0
600765	中航重机	100	允许	10%	0%	-
600782	新钢股份	300	允许	10%	0%	-
600787	中储股份	100	允许	10%	0%	-
600795	国电电力	1500	允许	10%	0%	-
600801	华新水泥	100	允许	10%	0%	-
600808	马钢股份	400	允许	10%	0%	-
600809	山西汾酒	100	允许	10%	0%	-
600811	东方集团	400	允许	10%	0%	-
600820	隧道股份	400	允许	10%	0%	-
600823	世茂股份	200	允许	10%	0%	-
600827	百联股份	100	允许	10%	0%	-
600835	上海机电	100	允许	10%	0%	-
600837	海通证券	1600	允许	10%	0%	-
600839	四川长虹	600	允许	10%	0%	-
600845	宝信软件	100	允许	10%	0%	-
600848	上海临港	200	允许	10%	0%	-
600859	王府井	100	允许	10%	0%	-
600862	中航高科	100	允许	10%	0%	-
600863	内蒙华电	500	允许	10%	0%	-
600867	通化东宝	200	允许	10%	0%	-
600871	石化油服	700	允许	10%	0%	-
600875	东方电气	200	允许	10%	0%	-
600879	航天电子	400	允许	10%	0%	-
600885	宏发股份	100	允许	10%	0%	-
600886	国投电力	500	允许	10%	0%	-
600887	伊利股份	900	允许	10%	0%	-
600893	航发动力	200	允许	10%	0%	-
600895	张江高科	100	允许	10%	0%	-
600900	长江电力	1900	允许	10%	0%	-
600901	江苏租赁	200	允许	10%	0%	-
600905	三峡能源	1400	允许	10%	0%	-
600906	财达证券	100	允许	10%	0%	-

600909	华安证券	500	允许	10%	0%	-
600917	重庆燃气	0	必须	-	-	0
600918	中泰证券	500	允许	10%	0%	-
600919	江苏银行	2000	允许	10%	0%	-
600926	杭州银行	500	允许	10%	0%	-
600927	永安期货	0	必须	-	-	0
600928	西安银行	200	允许	10%	0%	-
600941	中国移动	100	允许	10%	0%	-
600956	新天绿能	0	必须	-	-	0
600958	东方证券	900	允许	10%	0%	-
600959	江苏有线	500	允许	10%	0%	-
600967	内蒙一机	100	允许	10%	0%	-
600968	海油发展	300	允许	10%	0%	-
600970	中材国际	200	允许	10%	0%	-
600985	淮北矿业	200	允许	10%	0%	-
600988	赤峰黄金	200	允许	10%	0%	-
600989	宝丰能源	400	允许	10%	0%	-
600998	九州通	200	允许	10%	0%	-
600999	招商证券	600	允许	10%	0%	-
601000	唐山港	500	允许	10%	0%	-
601003	柳钢股份	100	允许	10%	0%	-
601005	重庆钢铁	1100	允许	10%	0%	-
601006	大秦铁路	1000	允许	10%	0%	-
601009	南京银行	900	允许	10%	0%	-
601012	隆基绿能	1000	允许	10%	0%	-
601016	节能风电	500	允许	10%	0%	-
601021	春秋航空	100	允许	10%	0%	-
601058	赛轮轮胎	400	允许	10%	0%	-
601066	中信建投	200	允许	10%	0%	-
601077	渝农商行	1000	允许	10%	0%	-
601088	中国神华	600	允许	10%	0%	-
601098	中南传媒	100	允许	10%	0%	-
601100	恒立液压	100	允许	10%	0%	-
601106	中国一重	500	允许	10%	0%	-
601108	财通证券	500	允许	10%	0%	-
601111	中国国航	500	允许	10%	0%	-
601117	中国化学	600	允许	10%	0%	-
601118	海南橡胶	300	允许	10%	0%	-
601128	常熟银行	500	允许	10%	0%	-
601138	工业富联	700	允许	10%	0%	-
601139	深圳燃气	100	允许	10%	0%	-
601155	新城控股	200	允许	10%	0%	-

601156	东航物流	0	必须	-	-	0
601162	天风证券	1200	允许	10%	0%	-
601166	兴业银行	2500	允许	10%	0%	-
601168	西部矿业	300	允许	10%	0%	-
601169	北京银行	2500	允许	10%	0%	-
601179	中国西电	300	允许	10%	0%	-
601186	中国铁建	800	允许	10%	0%	-
601187	厦门银行	200	允许	10%	0%	-
601198	东兴证券	300	允许	10%	0%	-
601200	上海环境	100	允许	10%	0%	-
601211	国泰君安	800	允许	10%	0%	-
601216	君正集团	600	允许	10%	0%	-
601225	陕西煤业	700	允许	10%	0%	-
601228	广州港	200	允许	10%	0%	-
601229	上海银行	1700	允许	10%	0%	-
601236	红塔证券	200	允许	10%	0%	-
601238	广汽集团	400	允许	10%	0%	-
601288	农业银行	5400	允许	10%	0%	-
601298	青岛港	100	允许	10%	0%	-
601318	中国平安	1800	允许	10%	0%	-
601319	中国人保	500	允许	10%	0%	-
601328	交通银行	4600	允许	10%	0%	-
601333	广深铁路	600	允许	10%	0%	-
601336	新华保险	100	允许	10%	0%	-
601360	三六零	500	允许	10%	0%	-
601377	兴业证券	900	允许	10%	0%	-
601390	中国中铁	1700	允许	10%	0%	-
601398	工商银行	5900	允许	10%	0%	-
601456	国联证券	100	允许	10%	0%	-
601555	东吴证券	700	允许	10%	0%	-
601568	北元集团	200	允许	10%	0%	-
601577	长沙银行	300	允许	10%	0%	-
601598	中国外运	300	允许	10%	0%	-
601600	中国铝业	1300	允许	10%	0%	-
601601	中国太保	600	允许	10%	0%	-
601607	上海医药	200	允许	10%	0%	-
601608	中信重工	300	允许	10%	0%	-
601611	中国核建	100	允许	10%	0%	-
601615	明阳智能	300	允许	10%	0%	-
601618	中国中冶	1200	允许	10%	0%	-
601628	中国人寿	300	允许	10%	0%	-
601633	长城汽车	200	允许	10%	0%	-

601636	旗滨集团	300	允许	10%	0%	-
601658	邮储银行	1800	允许	10%	0%	-
601665	齐鲁银行	100	允许	10%	0%	-
601668	中国建筑	3500	允许	10%	0%	-
601669	中国电建	1300	允许	10%	0%	-
601688	华泰证券	1000	允许	10%	0%	-
601696	中银证券	300	允许	10%	0%	-
601698	中国卫通	100	允许	10%	0%	-
601699	潞安环能	200	允许	10%	0%	-
601717	郑煤机	200	允许	10%	0%	-
601718	际华集团	400	允许	10%	0%	-
601728	中国电信	900	允许	10%	0%	-
601766	中国中车	2100	允许	10%	0%	-
601778	晶科科技	300	允许	10%	0%	-
601788	光大证券	300	允许	10%	0%	-
601799	星宇股份	0	必须	-	-	0
601800	中国交建	600	允许	10%	0%	-
601808	中海油服	100	允许	10%	0%	-
601816	京沪高铁	3300	允许	10%	0%	-
601818	光大银行	2800	允许	10%	0%	-
601825	沪农商行	200	允许	10%	0%	-
601828	美凯龙	100	允许	10%	0%	-
601838	成都银行	400	允许	10%	0%	-
601857	中国石油	1600	允许	10%	0%	-
601860	紫金银行	500	允许	10%	0%	-
601865	福莱特	100	允许	10%	0%	-
601866	中远海发	700	允许	10%	0%	-
601868	中国能建	2200	允许	10%	0%	-
601869	长飞光纤	0	必须	-	-	0
601872	招商轮船	500	允许	10%	0%	-
601877	正泰电器	200	允许	10%	0%	-
601878	浙商证券	300	允许	10%	0%	-
601880	辽港股份	1000	允许	10%	0%	-
601881	中国银河	200	允许	10%	0%	-
601888	中国中免	200	允许	10%	0%	-
601898	中煤能源	300	允许	10%	0%	-
601899	紫金矿业	2400	允许	10%	0%	-
601901	方正证券	700	允许	10%	0%	-
601916	浙商银行	1400	允许	10%	0%	-
601919	中远海控	1100	允许	10%	0%	-
601928	凤凰传媒	100	允许	10%	0%	-
601939	建设银行	1100	允许	10%	0%	-

601958	金钼股份	200	允许	10%	0%	-
601966	玲珑轮胎	100	允许	10%	0%	-
601969	海南矿业	100	允许	10%	0%	-
601985	中国核电	1600	允许	10%	0%	-
601988	中国银行	3500	允许	10%	0%	-
601989	中国重工	1900	允许	10%	0%	-
601990	南京证券	400	允许	10%	0%	-
601991	大唐发电	400	允许	10%	0%	-
601992	金隅集团	700	允许	10%	0%	-
601995	中金公司	100	允许	10%	0%	-
601997	贵阳银行	500	允许	10%	0%	-
601998	中信银行	500	允许	10%	0%	-
603000	人民网	100	允许	10%	0%	-
603019	中科曙光	200	允许	10%	0%	-
603026	石大胜华	0	必须	-	-	0
603056	德邦股份	100	允许	10%	0%	-
603077	和邦生物	1000	允许	10%	0%	-
603087	甘李药业	0	必须	-	-	0
603127	昭衍新药	0	必须	-	-	0
603156	养元饮品	100	允许	10%	0%	-
603160	汇顶科技	0	必须	-	-	0
603185	上机数控	0	必须	-	-	0
603195	公牛集团	0	必须	-	-	0
603198	迎驾贡酒	0	必须	-	-	0
603218	日月股份	100	允许	10%	0%	-
603225	新凤鸣	100	允许	10%	0%	-
603228	景旺电子	0	必须	-	-	0
603233	大参林	100	允许	10%	0%	-
603259	药明康德	300	允许	10%	0%	-
603260	合盛硅业	0	必须	-	-	0
603267	鸿远电子	0	必须	-	-	0
603288	海天味业	200	允许	10%	0%	-
603290	斯达半导	0	必须	-	-	0
603317	天味食品	0	必须	-	-	0
603345	安井食品	0	必须	-	-	0
603355	莱克电气	0	必须	-	-	0
603369	今世缘	100	允许	10%	0%	-
603379	三美股份	0	必须	-	-	0
603392	万泰生物	0	必须	-	-	0
603444	吉比特	0	必须	-	-	0
603456	九洲药业	100	允许	10%	0%	-
603486	科沃斯	0	必须	-	-	0

603501	韦尔股份	100	允许	10%	0%	-
603515	欧普照明	0	必须	-	-	0
603517	绝味食品	100	允许	10%	0%	-
603568	伟明环保	100	允许	10%	0%	-
603589	口子窖	100	允许	10%	0%	-
603605	珀莱雅	0	必须	-	-	0
603613	国联股份	100	允许	10%	0%	-
603638	艾迪精密	100	允许	10%	0%	-
603650	彤程新材	0	必须	-	-	0
603658	安图生物	0	必须	-	-	0
603659	璞泰来	100	允许	10%	0%	-
603707	健友股份	100	允许	10%	0%	-
603712	七一二	100	允许	10%	0%	-
603719	良品铺子	0	必须	-	-	0
603786	科博达	0	必须	-	-	0
603799	华友钴业	200	允许	10%	0%	-
603806	福斯特	100	允许	10%	0%	-
603833	欧派家居	0	必须	-	-	0
603858	步长制药	100	允许	10%	0%	-
603866	桃李面包	100	允许	10%	0%	-
603868	飞科电器	0	必须	-	-	0
603882	金域医学	0	必须	-	-	0
603883	老百姓	0	必须	-	-	0
603885	吉祥航空	100	允许	10%	0%	-
603899	晨光股份	100	允许	10%	0%	-
603927	中科软	100	允许	10%	0%	-
603939	益丰药房	100	允许	10%	0%	-
603983	丸美股份	0	必须	-	-	0
603986	兆易创新	100	允许	10%	0%	-
603993	洛阳钼业	1200	允许	10%	0%	-
605117	德业股份	0	必须	-	-	0
605499	东鹏饮料	0	必须	-	-	0
688002	睿创微纳	0	必须	-	-	0
688005	容百科技	0	必须	-	-	0
688006	杭可科技	0	必须	-	-	0
688008	澜起科技	0	必须	-	-	0
688009	中国通号	400	允许	10%	0%	-
688012	中微公司	0	必须	-	-	0
688029	南微医学	0	必须	-	-	0
688036	传音控股	0	必须	-	-	0
688065	凯赛生物	0	必须	-	-	0
688088	虹软科技	0	必须	-	-	0

688099	晶晨股份	0	必须	-	-	0
688111	金山办公	0	必须	-	-	0
688122	西部超导	0	必须	-	-	0
688126	沪硅产业	200	允许	10%	0%	-
688169	石头科技	0	必须	-	-	0
688180	君实生物	0	必须	-	-	0
688185	康希诺	0	必须	-	-	0
688188	柏楚电子	0	必须	-	-	0
688208	道通科技	0	必须	-	-	0
688256	寒武纪	0	必须	-	-	0
688289	圣湘生物	0	必须	-	-	0
688321	微芯生物	0	必须	-	-	0
688363	华熙生物	0	必须	-	-	0
688390	固德威	0	必须	-	-	0
688396	华润微	0	必须	-	-	0
688521	芯原股份	0	必须	-	-	0
688561	奇安信	0	必须	-	-	0
688599	天合光能	200	允许	10%	0%	-
688777	中控技术	0	必须	-	-	0
688819	天能股份	0	必须	-	-	0
688981	中芯国际	300	允许	10%	0%	-
689009	九号公司	0	必须	-	-	0
000001	平安银行	1600	深市退补	10%	20%	23856
000002	万科 A	1100	深市退补	10%	20%	22044
000009	中国宝安	400	深市退补	10%	20%	5496
000012	南玻 A	200	深市退补	10%	20%	1468

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。
- 5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或

对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

6、基金管理人根据市场情况在申购赎回清单中设置申购上限且当日总申购份额达到基金管理人所设定的上限。

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

8、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。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、7、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。

发生上述第 5 项暂停申购情形的，为保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人有权采取暂停基金申购等措施。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，也可以采取上述措施对基金规模予以控制。

如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、 暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价。

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

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。

5、基金管理人根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回上限且当日总赎回

份额达到基金管理人所设定的上限。

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

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

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 5 项以外的情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价时，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。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公告。

十、 基金份额的非交易过户等其他业务

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

十一、 其他申购赎回方式

1、联接基金是指将绝大多数基金财产投资于本基金，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。如果本基金推出联接基金，在本基金上市之前，联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

2、不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

3、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

4、在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前予以公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质

性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

6、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

十二、 基金份额的转让

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

基金管理人可在法律法规允许的范围内，在对基金份额持有人利益实质性不利影响的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第十一部分 基金的投资

一、 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

二、 投资范围

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

三、 投资策略

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份

股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响；（5）由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时；（6）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成制约等。

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

1、资产配置策略

本基金管理人完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

2、债券投资策略

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

3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

4、存托凭证投资策略

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

5、衍生品投资策略

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

6、参与融资及转融通证券出借业务策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

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

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

本基金参与股指期货交易和国债期货交易，应当遵循下列（9）-（14）要求：

(9) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

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

(11) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

(12) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

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

的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（14）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（15）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

（18）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（19）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（20）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

（21）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（6）、（16）、（17）、（19）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（19）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

五、 标的指数与业绩比较基准

1、 标的指数

本基金标的指数为中证 800 指数。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之

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

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

若出现指数更名等对基金投资无实质性影响的标的指数变更情形，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在规定媒介上公告。

2、标的指数编制方案及查询途径

中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。

（1）指数名称和代码

指数名称：中证 800 指数

指数简称：中证 800

英文名称：CSI 800 Index

英文简称：CSI 800

指数代码：000906

（2）指数基日和基点

该指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

（3）指数样本空间

同沪深 300 指数的样本空间

（4）选样方法：

1) 中证 500 指数

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

B. 对样本空间内剩余证券按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排

名后 20%的证券

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

2) 中证 800 指数

中证 500 和沪深 300 指数样本一起作为指数样本。

(5) 指数样本和权重调整

1) 定期调整

中证 500 指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 10%。

定 3

期调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间的剩余证券（剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后）前 90%的老样本可参与下一步日均总市值排名；日均总市值排名在 400 名之前的新样本优先进入，排名在 600 名之前的老样本优先保留。定期调整时设置备选名单，备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 5%。

2) 临时调整

特殊情况下将对中证 500 指数进行临时调整，当发生临时调整时，由最近一次指数定期调整时备选名单中排名最高的证券替代被剔除的证券。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当沪深 300、中证 100、中证 500 指数调整样本时。中证 200、中证 700 和中证 800 指数随之进行相应的调整。

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

3、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率。

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

六、 风险收益特征

本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

七、 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

八、 投资组合报告

（一） 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	192,425,064.98	98.99
	其中：股票	192,425,064.98	98.99
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,876,636.12	0.97
7	其他资产	83,430.68	0.04
8	合计	194,385,131.78	100.00

（二）报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,766.30	0.00
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,220,927.19	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	59,405.76	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,089.44	0.05
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	19,443.64	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	3,925.22	0.00
S	综合	—	—
	合计	1,452,516.45	0.75

（三）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,086,601.00	1.08
B	采矿业	5,747,611.40	2.97
C	制造业	108,379,504.75	55.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,731,590.30	2.44

E	建筑业	3,189,810.00	1.65
F	批发和零售业	2,538,041.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	5,119,625.60	2.64
H	住宿和餐饮业	199,015.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,198,727.04	4.23
J	金融业	36,509,963.84	18.84
K	房地产业	4,427,531.80	2.28
L	租赁和商务服务业	2,926,103.00	1.51
M	科学研究和技术服务业	2,885,856.60	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	434,214.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	165,161.20	0.09
Q	卫生和社会工作	2,014,731.80	1.04
R	文化、体育和娱乐业	961,497.20	0.50
S	综合	456,963.00	0.24
	合计	190,972,548.53	98.52

（四）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,700	8,601,000.00	4.44
2	600036	招商银行	90,700	4,575,815.00	2.36
3	601318	中国平安	79,400	3,839,784.00	1.98
4	000858	五粮液	14,100	3,093,399.00	1.60
5	601012	隆基股份	31,880	2,629,462.40	1.36
6	000333	美的集团	36,200	2,519,520.00	1.30

7	300059	东方财富	60,656	2,084,746.72	1.08
8	603259	药明康德	12,932	1,976,009.60	1.02
9	601166	兴业银行	106,700	1,952,610.00	1.01
10	002415	海康威视	34,400	1,892,000.00	0.98

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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688383	新益昌	2,195	297,378.60	0.15
2	688269	凯立新材	1,941	191,926.08	0.10
3	688707	振华新材	3,794	108,622.22	0.06
4	688201	信安世纪	1,672	81,125.44	0.04
5	688161	威高骨科	1,154	80,156.84	0.04

(五) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

(十) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

（十一）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金将基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征，在风险可控的基础上，以套期保值为目的，参与国债期货的投资，以降低跟踪误差。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

（十二）投资组合报告附注

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

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股

份有限公司（以下简称“公司”），由于存在：违规办理内保外贷业务；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇市场交易管理规定；未按规定保存交易通讯记录；违规办理银行卡业务的违法违规事实，国家外汇管理局福建省分局于2021年7月21日对公司做出责令改正、警告、没收违法所得和罚款合计300.10537万元人民币的行政处罚（闽汇罚〔2021〕5号）。兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在违反规定办理结汇、售汇的行为，国家外汇管理局深圳市分局于2020年11月27日对公司做出责令改正，处以罚款人民币55万元，没收违法所得128.82万元人民币的行政处罚（深外管检〔2020〕92号）；由于存在：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位；理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等27项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于2021年5月17日对公司做出罚款7170万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16号）。招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余8名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,694.87
2	应收证券清算款	39,725.25

3	应收股利	—
4	应收利息	202.64
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	37,807.92
8	其他	—
9	合计	83,430.68

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688383	新益昌	297,378.60	0.15	新股限售
2	688269	凯立新材	191,926.08	0.10	新股限售
3	688707	振华新材	108,622.22	0.06	新股限售
4	688201	信安世纪	81,125.44	0.04	新股限售
5	688161	威高骨科	80,156.84	0.04	新股限售

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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

一、 本基金历史各时间段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2020.05.13-2020.12.31	30.76%	1.19%	27.62%	1.27%	3.14%	-0.08%
2021.01.01-2021.09.30	8.58%	1.16%	-2.71%	1.17%	11.29%	-0.01%
2020.05.13-2021.09.30	41.98%	1.18%	24.16%	1.22%	17.82%	-0.04%

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



注：1、截止日期为2021年9月30日。

2、本基金于2020年5月13日成立，建仓期6个月，从2020年5月13日起至2020年11月12日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

第十三部分 基金的财产

一、 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

二、 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、 基金财产的账户

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

四、 基金财产的保管和处分

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

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

第十四部分 基金资产的估值

一、 估值日

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

二、 估值对象

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

三、 估值原则

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

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

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

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

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

四、 估值方法

1、 证券交易所上市的非固定收益品种的估值

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

2、 交易所市场交易的固定收益品种的估值

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

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、处于未上市期间以及流通受限的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

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

7、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

8、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人

承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

五、 估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

六、 估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报

基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

七、 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、 基金净值的确认

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

九、 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误等非基金管理人及基金托管人原因，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，但未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、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。

第十五部分 基金的收益与分配

一、 基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

二、 收益分配方案

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

三、 收益分配方案的确定、公告与实施

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

四、 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

第十六部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的标的指数许可使用费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货等交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 10、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用，银行账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起

2个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

3、基金的标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同）大于人民币 5000 万元的，指数许可使用费的收取下限金额为每季度人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；如当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，指数许可使用费不设下限。

指数许可使用费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付。指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于下一个季度开始后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式

等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应按照基金合同的约定在规定媒介予以公告。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

二、与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时，请参照本招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”中“六、申购和赎回的对价、费用及其用途”的相关规定。

三、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十七部分 基金的会计与审计

一、 基金会计政策

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

二、 基金的年度审计

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

第十八部分 基金的信息披露

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

二、 信息披露义务人

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

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

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

三、 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告

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

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

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

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

5、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。

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

（二）基金合同生效公告

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

（三）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且未上市交易前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（四）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

（五）基金份额申购、赎回对价

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、赎回对价的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在规定媒介上公告。

（七）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过其规定网站以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

（八）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。基金管理人有权确定基金份额折算日，并提前公告。

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

（九）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》的会计师事务所审计。

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

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

《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。

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

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

（十）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，

并登载在指定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金终止上市交易、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 15、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
- 16、本基金开始办理申购、赎回；
- 17、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

- 18、基金变更标的指数；
- 19、基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市；
- 20、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- 21、调整基金份额类别的设置；
- 22、基金推出新业务或服务；
- 23、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（十一）澄清公告

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

（十二）清算报告

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

（十三）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十四）投资资产支持证券的信息

基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十五）投资股指期货的信息

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

投资政策和投资目标。

（十六）投资国债期货的信息

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

（十七）参与融资及转融通证券出借业务的信息

若本基金参与融资及转融通证券出借业务，应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

（十八）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

（十九）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且

在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

七、 暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 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资产价值或无法进行信息披露时；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

八、 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办公场所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

第十九部分 风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

1、市场风险

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

（1）政策风险

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

（2）经济周期风险

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

（3）利率风险

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

（4）购买力风险

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

2、流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回对价的风险。

（1）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括中证 800 指数的成份股、备选成份股、其他股票、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具、现金资产等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动

性风险适中。

(2) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响
在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对基金份额持有人赎回的情形时，基金管理人将以保障基金份额持有人合法权益为前提，按照法律法规、基金合同等规定，选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将对风险进行监测和评估，使用前与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回对价支付等可能受到相应影响，基金管理人将依照法律法规、基金合同等规定进行操作，保障基金份额持有人的合法权益。

(3) 本基金最小申购、赎回单位设置较高，中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

3、信用风险

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

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

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

6、管理风险

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

7、操作或技术风险

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

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

8、合规性风险

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

9、基金估值风险

指每个工作日基金估值可能发生错误的风险。

10、本基金的特定风险

（1）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。

（2）跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

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

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

6) 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。

7) 基金现金资产的拖累会影响本基金对标的指数的跟踪程度。

8) 特殊情况下，如果本基金采取成份股替代策略，基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与标的指数收益率产生偏离。

9) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（3）标的指数变更的风险

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

（4）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，当成份股发生停牌等流动性约束情形时，本基金可能面临如下风险：

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平；投资者可能由于无法买入成份股而影响溢价套利或无法卖出成份股而影响折价套利。本基金的申购赎回清单中可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置了现金替代比例上限。因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”之“七、申购、赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差；

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

（5）指数编制机构停止服务的风险

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

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

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

（6）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

（7）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

（8）退市风险

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

（9）投资者申购失败的风险

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

投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商如发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

（10）投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

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

（11）退补现金替代方式的风险

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

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

（12）基金份额赎回对价的变现风险

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

有差异，存在变现风险。

（12）套利风险

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

（14）申购赎回清单差错风险

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

（15）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

3) 第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

（16）资产支持证券的投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

（17）股指期货、国债期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其

评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

（18）融资及转融通证券出借业务风险

本基金可参与融资与转融通证券出借业务，面临的的风险包括但不限于：1、流动性风险，指面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；2、信用风险，指证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；3、市场风险，指证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；4、其他风险，如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

（19）基金投资存托凭证的风险

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

1) 与存托凭证相关的风险

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

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

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

④存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但

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

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

⑥存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

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

2) 与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

3) 与境外发行人相关的风险

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

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

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

4) 与交易机制相关的风险

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

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

可能对境内证券价格产生影响。

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

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

11、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

12、其他风险

（1）随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）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；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

（7）其他意外导致的风险。

二、 声明

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

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金销售机构公开发售，基金管理人与基金销售机构都不保证其收益或本金安全。

第二十部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

一、 基金合同的变更

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

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

二、 基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

三、 基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
 - (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
 - (3) 对基金财产进行估值和变现；
 - (4) 制作清算报告；
 - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
 - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
 - (7) 对基金剩余财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

四、 清算费用

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

五、 基金财产清算剩余资产的分配

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

六、 基金财产清算的公告

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

七、 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十一部分 基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

实施其他法律行为；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回等的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付投资者赎回对价；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户；按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，

基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
 - (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
- (三) 基金份额持有人的权利和义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金认购款项和认购股票、申购对价及法律法规和基金合同所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构，若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行。

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

（一）召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

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

2、在不违反法律法规和基金合同约定的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，且在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或者变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，标的指数更名或调整指数编制方法，以及变更业绩比较基准；

(6) 按照中证指数有限公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费费率和计算方法；

(7) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(8) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、相关证券交易所、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、基金交易、非交易过户、转托管等内容；

(9) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(10) 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告的时间或频率；

(11) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其

他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人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、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

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

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、 争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照申请仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

五、 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

第二十二部分 基金托管协议的内容摘要

一、 基金托管协议当事人

（一） 基金管理人

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼

法定代表人：裴长江

成立时间：1999 年 4 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】11 号

注册资本：5.2 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

存续期间：持续经营

电话：021-20361818

（二） 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

二、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一） 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

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

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

3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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

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

本基金参与股指期货交易和国债期货交易，应当遵循下列9)-14)要求：

9) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

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

11) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

12) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

13) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

14) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

18) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

19) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行。

除上述第 6)、16)、17)、19) 条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（19）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

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

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

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，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者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资。

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

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

4、基金托管人依据以下约定对基金管理人参与银行间债券市场投资进行监督。

基金管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以 DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

5、关于银行存款投资

本基金投资银行存款的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。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的

损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致。流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

（3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（5）基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，

有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

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

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

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

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

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的合理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。

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

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

三、 基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

（二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的富国基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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事宜。

（三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金

的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

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

（四） 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让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。

（五） 债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

（六） 其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（七）基金财产投资的有关银行存款证实书等实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。法律法规、监管机构、基金合同另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按基金净值按规定予以公布。

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，本基金的会计责任方是基金管理人，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。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。

六、 基金份额持有人名册的保管

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

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保管期限为20年。基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。基金登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、 争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

八、 托管协议的变更与终止

（一） 托管协议的变更与终止

1、 托管协议的变更程序

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

2、 基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

（二） 基金财产的清算

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

2、 在基金财产清算小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》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

5、基金财产清算程序：

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

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

6、清算费用

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

7、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（三）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，由基

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

（四）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十三部分 对基金份额持有人的服务

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

一、 基金份额持有人交易资料服务

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

二、 网上交易、查询服务

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

三、 信息定制及资讯服务

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

四、 网络在线服务

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

五、 客户服务中心电话服务

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

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

专项服务，节假日除外。

六、 客户投诉受理服务

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

七、 基金管理人客户服务联络方式

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

客户服务传真：021-20513277

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

电子信箱：public@fullgoal.com.cn

客服中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

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

第二十四部分 其他应披露事项

号	公告日期	信息披露媒介	公告事项
1.	2020年12月21日	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	富国基金管理有限公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告
2.	2021年1月21日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
3.	2021年1月30日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
4.	2021年2月3日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
5.	2021年3月4日	证券时报	富国基金管理有限公司关于富国中证800交易型开放式指数证券投资基金变更证券简称及基金扩位简称的公告
6.	2021年3月13日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
7.	2021年3月17日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
8.	2021年3月24日	证券时报、中国证券	富国基金管理有限公司关于

		报、上海证券报、证券日报	旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
9.	2021年3月30日	证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告
10.	2021年4月14日	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
11.	2021年4月20日	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
12.	2021年5月6日	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
13.	2021年5月10日	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
14.	2021年7月2日	证券时报、上海证券报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告
15.	2021年8月31日	中国证券报、证券时报	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告

第二十五部分 招募说明书存放及其查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，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，但应以基金备查文件正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

第二十六部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

（二）《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金之法律意见

（七）注册登记协议

（八）中国证监会要求的其他文件

富国基金管理有限公司

2022 年 8 月 1 日