

# 宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金于2019年10月29日经中国证监会证监许可[2019]2101号文注册，基金合同于2020年3月26日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；本基金的特定风险等。

本基金可投资于股指期货，当基金所投资的股指期货主要被用来套期保值时，可能产生的投资风险主要为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。同时在股指期货投资过程中还面对卖空风险（同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通股票型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通股票型基金蒙受更大损失）、杠杆风险（因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动）、平仓风险（在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓）等风险。

本基金可投资于股票期权，其风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金可投资资产支持证券，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。

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或违约等潜在风险，具体风险详见本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金单一投资者持有份额集中度不得达到或者超过50%且不存在通过一致行动人等方式变相规避50%集中度的情形，但因其他投资者赎回使得单一投资者持有份额集中度被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件，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。

本基金本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容，涉及“重要提示”、“基金的投资”、“基金资产的估值”、“风险揭示”等章节，并对基金管理人等信息一并更新，相关信息更新截止日为2023年9月6日，其他所载内容截止日为2023年3月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年12月31日。财务数据未经审计。

我公司已于2022年11月30日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》，原股东天津市泰达国际控股（集团）有限公司将其持有的本公司51%股权转让给宏利投资管理（新加坡）私人有限公司。变更后的股东及持股比例分别为：宏利投资管理（新加坡）私人有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%。本次股权变更后，本公司的注册资本保持

不变。

我公司已于2023年4月22日发布《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人名称由“泰达宏利基金管理有限公司”变更为“宏利基金管理有限公司”，该名称变更事项已于2023年4月完成工商变更登记手续。

## 目 录

一、绪言 .....	6
二、释义 .....	7
三、基金管理人 .....	12
四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	25
六、基金的募集 .....	49
七、基金合同的生效 .....	49
八、基金份额的申购与赎回 .....	50
九、基金的标的指数 .....	62
十、基金的投资 .....	64
十一、基金的业绩 .....	76
十二、基金的财产 .....	79
十三、基金资产的估值 .....	80
十四、基金的收益与分配 .....	86
十五、基金费用与税收 .....	87
十六、基金的会计与审计 .....	90
十七、基金的信息披露 .....	91
十八、风险揭示 .....	98
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	105
二十、基金合同的内容摘要 .....	107
二十一、基金托管协议的内容摘要 .....	131
二十二、对基金份额持有人的服务 .....	144
二十三、其他应披露事项 .....	145
二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....	150
二十五、备查文件 .....	150

## 一、 绪言

《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定以及《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、 释义

在《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金招募说明书》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：指宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金
- 2、基金管理人：指宏利基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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
- 10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的

修订

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

13、《流动性风险管理规定》：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

14、《指数基金指引》：指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投



资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指宏利基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

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

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

29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

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

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《宏利基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

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

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

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

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

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

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

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

47、元：指人民币元

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

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

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

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

55、基金份额类别：指根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

56、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

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

58、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

59、A类基金份额：指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

60、C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用的基金份额

61、标的指数：指中证主要消费红利指数及其未来可能发生的变更

62、指数编制机构：指中证指数有限公司

### 三、基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：宏利基金管理有限公司

设立日期：2002年6月6日

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

法定代表人：高贵鑫

组织形式：有限责任公司

信息披露联系人：张强

联系电话：010-66577762

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：宏利投资管理（新加坡）私人有限公司：51%；宏利投资管理（香港）有限公司：49%

宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司，成立于2002年6月。截至目前，公司管理着包括宏利价值优化型系列基金、宏利行业精选混合型证券投资基金、宏利风险预算混合型证券投资基金、宏利货币市场基金、宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、宏利首选企业股票型证券投资基金、宏利市值优选混合型证券投资基金、宏利集利债券型证券投资基金、宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、宏利红利先锋混合型证券投资基金、宏利沪深300指数增强型证券投资基金、宏利领先中小盘混合型证券投资基金、宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、宏利逆向策略混合型证券投资基金、宏利宏达混合型证券投资基金、宏利淘利债券型证券投资基金、宏利转型机遇股票型证券投资基金、宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、宏利活期友货币市场基金、宏利汇利债券型证券投资基金、宏利睿智稳健灵活配置混合型证

券投资基金、宏利京元宝货币市场基金、宏利纯利债券型证券投资基金、宏利溢利债券型证券投资基金、宏利恒利债券型证券投资基金、宏利全能优选混合型基金中基金（FOF）、宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金在内的六十多只证券投资基金。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

金旭女士，董事长，北京大学及美国纽约大学硕士研究生。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会工作。2001 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007 年 5 月至 2014 年 12 月任国泰基金管理有限公司总经理。2015 年 1 月至 2022 年 1 月先后任招商基金管理有限公司总经理及/或副董事长。2022 年 1 月至 2022 年 10 月任招商银行股份有限公司总行巡视员。2022 年 11

月加入宏利投资（上海）有限公司，现任中国区财富及资产管理主席及宏利投资（上海）有限公司执行董事、总经理兼法定代表人。2022年12月23日起任公司董事长。

高贵鑫先生，董事。毕业于上海交通大学、中国人民大学，分获学士、硕士学位。2000年10月加入华夏基金任高级经理等职；2006年3月加入大成基金，历任副总监、总监等职；2012年3月加入国泰基金任公司执委会委员、总经理助理等职；2015年4月加入大成基金任公司执委会委员、总经理助理等职；2020年1月加入渤海银行任总行资产管理部副总经理等职；2021年11月加入方正证券，任资管分公司总经理等职。2022年12月加入公司，任公司总经理（法定代表人）兼首席信息官兼财务负责人。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基梅隆大学，持有数学及管理科学学士学位，现为宏利投资管理（亚洲）总裁兼亚洲区主管及宏利投资管理（新加坡）私人有限公司、宏利投资管理（香港）有限公司董事，掌管亚洲（包括日本）的资产管理业务，负责推动宏利在亚洲区内资产管理业务规模的不断发展与壮大。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区（香港除外）的资产管理业务。2001年至2004年，杜先生驻于波士顿，负责领导机构息差产品的开发工作。杜先生于2001年加入宏利，之前任职于一家国际评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管。杜先生拥有三十多年的资本市场及资产管理经验。

CHAD FOYN 先生，董事。毕业于南非大学和夸祖鲁-纳塔尔大学，分别获得会计科学学士和会计硕士学位。2000年1月至2003年3月在德勤会计师事务所（南非及美国）担任审计师，2003年5月至2004年6月在瑞士信贷（英国）担任风险分析师，2004年6月至2006年8月在美林证券（英国）担任副总裁，2008年8月至2019年5月在澳洲联邦银行悉尼分行和香港分行担任执行经理及首席财务官，2019年5月至2022年6月在宏利投资管理（香港）有限公司担任首席财务官，2022年7月至今在宏利投资管理国际控股有限公司担任首席财务官。

查卡拉·西索瓦先生，独立董事。拥有艾戴克高等商学院（北部）工商管理学士、法国金融分析学院财务分析学位、芝加哥商学院工商管理学硕士等学

位。曾担任欧洲联合银行（巴黎）组合经理助理、组合经理，富达管理与研究有限公司（东京）高级分析师，NatWest Securities Asia 亚洲运输研究负责人，Credit Lyonnais International Asset Management 研究部主管、高级分析师，Comgest 远东有限公司董事总经理、基金经理及董事。现任 Jayu Ltd. 负责人。

樸睿波先生，独立董事。拥有美国西北大学经济学学士、美国西北大学凯洛格管理学院管理学硕士、美国西北大学凯洛格管理学院金融学博士等学位。曾担任联邦储备系统管理委员会金融经济师，芝加哥商业交易所高级金融经济师，Ennis Knupp & Associates 合伙人、研究主管，Martingale 资产管理公司（波士顿）董事，Commerz 国际资本管理（CICM）（德国）联合首席执行官/副执行董事，德国商业银行（英国）资产管理部董事总经理。现任上海交通大学高级金融学院实践教授。

陆敏，独立董事。毕业于上海交通大学和美国纽约州立大学，分别获得工学学士学位和工商管理硕士学位。1985年7月至1987年6月任上海第二工业大学材料系助教，1987年7月至1990年6月任海上世界股份有限公司上海分公司旅游部经理，1994年9月至2000年9月任怡富证券上海代表处首席代表，2001年10月至2002年7月任荷兰合作银行上海分行副总裁，2002年8月至2006年4月任荷兰银行资产管理上海代表处首席代表，2006年5月至2007年5月担任光辉国际上海合伙人，2007年6月至2016年2月任荷宝基金上海代表处首席代表，2016年2月至2017年7月任荷宝投资（上海）有限公司总经理，2018年3月至2021年6月任瀚亚投资管理（上海）有限公司顾问/总经理，2021年7月至今担任同济校友基金投资合伙人，同时在其投资的上海百年恺歌广告有限合伙企业担任投资合伙人委派代表。

## 2、监事成员

邓嘉明先生，监事。拥有香港科技大学，工商管理硕士；资讯系统管理学硕士；香港城市大学，仲裁及争议解决法学硕士学位。1986年-1990年在罗兵咸会计师事务所担任审计主管，负责审计工作；1990年-1996年在香港证券及期货监察委员会担任中介团体监察科高级经理，负责监察工作；1996年-1999年在大和证券（香港）担任监察及内部核算部主管，负责监察及内部核算

工作；1999年-2002年在汇富集团（Kingsway Group）担任监察科董事/业务拓展部董事，负责监察/业务拓展工作；2002年-2003年在 Alpha Alliance Group 担任营运总监，负责营运管理工作；2004年-2007年在景顺集团

（INVESCO）担任监察科董事/业务拓展部董事，负责监察/业务拓展工作；2007年-2008年在荷银投资管理（亚洲）担任大中华区监察、法律及风险管理部主管，负责监察、法律及风险管理工作；2008年-2013年在德意志资产管理有限公司担任监察部主管，负责监察工作；2013年至今在宏利投资管理（香港）有限公司担任亚洲区财富及资产管理规管部主管，负责监察工作。

薛涛先生，职工监事。毕业于中国人民大学，工商管理专业硕士。曾就职于北京燕金源置业有限公司。2011年7月加入宏利基金管理有限公司，历任行政主管、综合管理部总经理助理、综合管理部副总经理、综合管理部总经理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

高贵鑫先生，公司总经理（法定代表人）兼首席信息官兼财务负责人，简历同上。

汪兰英女士，常务副总经理；毕业于浙江大学与北京大学，分别获得工学学士和法学学士学位；2001年7月至2002年2月曾任职于中信证券股份有限公司风险投资部；2002年2月至2013年11月曾任职于中国证监会基金监管部；2013年12月至2016年7月曾任职于中国人寿资产管理有限公司基金投资部等部门，担任部门负责人；2016年9月至2020年12月任职于易方达基金管理有限公司，曾担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）；2021年1月至2022年8月，曾任职于国新投资有限公司，担任副总经理兼国新新格局私募证券投资基金总经理；2022年9月加入宏利基金管理有限公司，2022年10月至2022年12月起任公司常务副总经理并代任公司总经理。现任公司常务副总经理兼任投资总监（权益）。

刁羽先生，副总经理，毕业于上海财经大学，金融数学与金融工程博士。2007年2月至2009年2月任职于国泰君安证券股份有限公司，担任自营投资组交易员。2009年2月至2009年6月任职于浦银安盛基金管理公司，担任基金经理助理。2009年6月至2014年3月任职于富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理。2014年4月至2014年5月任职于鑫元基金



管理有限公司。2014年7月至2023年7月任职于中欧基金管理有限公司，历任固收投决会委员/投资总监/投资经理、基金经理。2023年7月加入宏利基金管理有限公司，2023年9月起任公司副总经理。

刘晓玲女士，副总经理，毕业于河北大学，获经济学学士学位。2002年9月至2011年7月就职于博时基金管理有限公司，任零售业务部渠道总监；2011年7月至2013年9月任富国基金管理有限公司零售业务部负责人；2013年9月至2015年4月任泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监；2015年4月加入融通基金管理有限公司，2015年9月至2018年7月任融通基金管理有限公司副总经理；2018年8月加入宏利基金管理有限公司，2018年9月起任宏利基金管理有限公司副总经理。

徐娇女士，督察长，毕业于西北政法大学，经济法学硕士。2011年7月至2013年4月就职于南京证券股份有限公司任项目经理；2013年4月至2016年4月就职于中国证券业协会任高级主办；2016年4月至2019年6月就职于第一创业证券股份有限公司任部门负责人；2019年6月至2021年2月就职于金鹰基金管理有限公司任督察长；2021年2月加入宏利基金管理有限公司，2021年2月起任公司督察长。

#### 4、基金经理

刘欣先生：清华大学理学硕士；2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、投资副总监，现担任公司总经理助理兼基金经理；2014年1月3日至今担任宏利逆向策略混合型证券投资基金基金经理；2015年2月13日至今担任宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年9月26日至今担任宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理；2020年1月19日至今担任宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金基金经理；2020年3月26日至今担任宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金经理；2021年1月19日至今担任宏利波控回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理。具备16年基金从业经验，16年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

刘洋先生:北京大学理学硕士;2015年1月至2015年4月就职于九坤投资(北京)有限公司,担任策略分析师;2015年5月加入宏利基金管理有限公司,任职于金融工程部,先后担任助理研究员、研究员、基金经理助理、策略投资部总经理助理等职务,现担任策略投资部副总经理兼基金经理;2019年1月9日至今担任宏利沪深300指数增强型证券投资基金基金经理;2019年11月6日至今担任宏利中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理;2020年3月26日至今担任宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金经理;具备8年证券投资管理经验,具有基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员由公司总经理高贵鑫、常务副总经理汪兰英兼任投资总监(权益)、总经理助理刘欣、权益投资部总经理王鹏、研究部总监张勋、资深基金经理吴华、宏观策略投资部副总经理兼首席策略分析师兼基金经理庄腾飞、固定收益部总经理助理兼基金经理宁霄、基金经理李宇璐、基金经理高春梅、固收研究部总经理陈星屹。

投资决策委员会根据决策事项,可分类为固定收益类事项、权益类事项、其它事项:

(1) 固定收益类事项由高贵鑫、汪兰英(主任委员)、宁霄、李宇璐、陈星屹、高春梅表决。

(2) 权益类事项由汪兰英(主任委员)、刘欣、王鹏、张勋、吴华、庄腾飞表决。

(3) 其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在亲属关系。

#### 三、基金管理人的职责

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

2、办理本基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金资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、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

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

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- （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、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、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、规章及行业规范，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) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (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) 违反法律法规的规定，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；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 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；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

(3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

## 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任；

(2) 督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

(3) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

(4) 风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

(5) 监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

(6) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

## 3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

(5) 建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

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

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 4、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

## 四、 基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力

建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号；2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”；2021年荣获全国银行间同业拆借中心首次设立的“银行间本币市场优秀托管行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设风险合规部/综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、系统与信息管理部、营运管理部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近283名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2022年12月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共786只。

### (二)、基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

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

#### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险



管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

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

#### （三）、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：宏利基金网上直销系统

#### （1）网上交易系统网址：

<https://etrade.manulifefund.com.cn/etrading>

支持本公司旗下基金网上直销的银行卡（含第三方支付）：中国银行卡、农业银行卡、建设银行卡、交通银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、浦发银行卡和平安银行卡等。

（2）宏利基金微信公众账号：manulifefund\_BJ

支持快钱支付及农行快捷支付。

客户服务电话：4006988888/010-66555662

客户服务信箱：irm@manulifefund.com.cn

名称：宏利基金管理有限公司直销中心

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

联系人：刘恋

联系电话：010-66577617

客服信箱：irm@manulifefund.com.cn

客服电话：4006988888/010-66555662

传真：010-66577760/61

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

## 2、代销机构

1) 名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

联系人：张伟

银行网站：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

2) 名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

联系人：刘文霞

银行网站：www.boc.cn

3) 名称：交通银行股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

联系人：王菁

银行网址：www.bankcomm.com

4) 名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系人：季平伟

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

5) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

联系人：肖武侠

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

6) 名称：平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路5047号s

办公地址：深圳市深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

客户服务热线：95511-3

公司网站：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

7) 名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路167号兴业大厦9层

法定代表人：吕家进

客户服务电话：95561

联系人：李博

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

8) 名称：东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路21号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：卢国锋

联系人：朱杰霞

客服电话：4001196228

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

9) 名称：宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

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

10) 名称：北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：霍学文

客户服务电话：95526

联系人：盖君

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

11) 名称: 广东顺德农村商业银行股份有限公司

注册地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号

办公地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号

法定代表人: 姚真勇

联系人: 杨素苗

客服电话: 0757-22223388

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

12) 名称: 光大银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

办公地址: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人: 李晓鹏

联系人: 刘玉晨

客户服务热线: 95595

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

13) 名称: 中国人寿保险股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街16号

办公地址: 北京市西城区金融大街16号中国人寿广场A座4层

法定代表人: 白涛

联系人: 秦泽伟

电话: 010-63631539

公司网址: [www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

客服热线: 95519

14) 名称: 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址: 上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人: 贺青

客服电话: 95521

联系人: 黄博铭

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

15) 名称: 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: 北京市东城区朝内大街188号  
法定代表人: 王常青  
客服电话: 95587/4008-888-108  
联系人: 权唐  
公司网站: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

16) 名称: 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号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦21楼  
法定代表人: 张纳沙  
客服电话: 95536  
联系人: 李颖  
公司网站: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

17) 名称: 招商证券股份有限公司  
注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路111号  
办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层  
法定代表人: 霍达  
联系人: 黄婵君  
客户服务电话: 95565, 400-888-8111  
公司网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

18) 名称: 广发证券股份有限公司  
注册地址: 广东省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、39、41、42、43、44楼

法定代表人: 林传辉  
客服电话: 95575或致电各地营业网点  
联系人: 黄岚  
公司网站: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

19) 名称: 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

法定代表人: 陈亮

客服电话: 4008-888-888或95551

联系人: 辛国政

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

20) 名称: 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路689号

办公地址: 上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人: 周杰

客服电话: 95553, 400-8888-001

联系人: 金芸

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

21) 名称: 申万宏源证券有限公司

英文名称: Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.

注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层 (邮编: 200031)

法定代表人: 杨玉成

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

客服电话: 95523或4008895523

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

联系人: 余洁

22) 名称: 湘财证券股份有限公司

注册地址: 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层

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层

法定代表人: 高振营

客服电话: 95351

联系人：李欣

公司网站：www.xcsc.com

23) 名称：渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：安志勇

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

24) 名称：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

法定代表人：张伟

客户服务电话：95597

联系人：郭力铭

公司网站：www.htsc.com.cn

25) 名称：长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：张巍

联系人：金夏

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

26) 名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：刘秋明

联系人：何耀

客户服务电话：95525



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

27) 名称：中信证券华南股份有限公司

公司简称：中信证券（华南）

注册地址：广州市天河区临江大道395号901室(部位:自编01),1001室

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楼、20楼

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

联系人：梁微

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

28) 名称：南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路389号

办公地址：江苏省南京市江东中路389号

法定代表人：李剑锋

联系人：王万君

客户服务电话：95386

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

29) 名称：诚通证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：张威

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

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

30) 名称：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：深圳市福田区莲花街道金田路4036号荣超大厦18层

法定代表人：何之江

客服电话：0755-22627723

联系人：王阳

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

31) 名称：国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
(100007)

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
(100007)

法定代表人：翁振杰

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

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

32) 名称：东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

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

33) 名称：世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦北塔23-25楼

法定代表人：余维佳

联系人：王雯

客服电话：4008323000

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

34) 名称：华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

客服电话：95547

联系人：王虹

公司网站：www.hfzq.com.cn

35) 名称：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

联系人：周楷钰

网址：<http://www.essence.com.cn/>

36) 名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：济南市市中区经七路86号

法定代表人：李峰

客服电话：95538

联系人：张峰源010-59013769

公司网站：www.zts.com.cn

37) 名称：申万宏源西部证券有限公司

英文名称：Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co., Ltd.

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（邮编：830002）

法定代表人：王献军

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户服务电话：95523或4008895523

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

联系人：梁丽

38) 名称：长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579或400-888-8999

联系人：奚博宇

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

39) 名称：国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

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

40) 名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

公司网址：<http://www.cs.ecitic.com/newsite/>

客服热线：95548

41) 名称：西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

客服电话：95582

联系人：张吉安

公司网站：[www.west95582.com](http://www.west95582.com)

42) 名称:中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人: 吴小静

联系人: 罗艺琳

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

客服热线: 95329

43) 名称:万联证券股份有限公司

注册地址: 广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

办公地址: 广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层

法定代表人: 王达

联系人: 丁思

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

客服热线: 95322

44) 名称: 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人: 陈佳春

客服热线: 95548

联系人: 刘晓明

公司网址: <http://sd.citics.com/>

45) 名称: 西南证券股份有限公司

注册地址: 重庆市江北区金沙门路32号

办公地址: 重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人: 吴坚

客服热线: 400-809-6096、95355

联系人: 周青

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

46) 名称: 东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：陈照星

客服电话：95328

联系人：陈士锐

网站：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

47) 名称：中信期货有限公司

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13层1301-1305、14层

办公地址：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13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

联系人：梁美娜

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

48) 名称：天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市中北路天风大厦

法定代表人：余磊

联系人：王雅薇

客户服务热线：95391 / 400-800-5000

公司网址：<https://www.tfzq.com/>

49) 名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)；[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

50) 名称：诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服电话：400-821-5399

51) 名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

52) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

客户服务电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

53) 名称：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

54) 名称：上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

公司网址：www.erichfund.com

55) 名称：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

56) 名称：北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

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

57) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

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

58) 名称：一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

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

59) 名称：上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋2楼

法定代表人：金佶

客服电话：021-34013996

公司网址：[https:// www.hotjijin.com](https://www.hotjijin.com)

60) 名称：上海陆金所基金销售有限公司



注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：王之光

客服电话：400-821-9031

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

61) 名称：北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

客服电话：400-8980-618

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

62) 名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座6层

法定代表人：马勇

客服电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn/>

63) 名称：上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

客服电话：400-166-6788

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

64) 名称：北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4001599288

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

65) 名称：武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区泛海国际SOHO城（一期）2301室

办公地址：湖北省武汉市江汉区台北一路环亚大厦B座6楼

法定代表人：陶捷

客服电话：4000279899

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

66) 名称：北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21-28层

法定代表人：蒋煜

客服电话：010-58170761

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

67) 名称：北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室

办公地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心B座19层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

公司网址：<http://www.niuniufund.com>

68) 名称：北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1138号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

69) 名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座

法定代表人：赵芯蕊

客服电话：010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

70) 名称: 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址: 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人: 王翔

客服电话: 400-820-5369

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

71) 名称: 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

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

72) 名称: 上海云湾基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区

办公地址: 上海市浦东新区新金桥水路27号1号楼

法定代表人: 冯轶明

客服电话: 400-820-1515

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

73) 名称: 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座17层

法定代表人: 王苏宁

客服电话: 95118

传真: 010-89189566

公司网站: [kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

74) 名称: 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

客服电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

75) 名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼

法定代表人：李兴春

客服电话：4009217755

公司网址：www.leadfund.com.cn

76) 名称：济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

公司网址：www.jianfortune.com

77) 名称：万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓

2-2413

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

法定代表人：李修辞

客服电话：010-59013825

公司网址：www.wanjiawealth.com

78) 名称：宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

79) 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼

法定代表人：刘明军

客服电话：95017（拨通后转1转8）

公司网址：www.tenganxinxi.com

80) 名称：江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

81) 名称：上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室

法定代表人：冷飞

客服电话：400-711-8718

公司网址：www.wacaijijin.com

82) 名称：北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

83) 名称：海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：惠晓川

客服电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

84) 名称：北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

法定代表人：孙博超

客服电话：95055-4

公司网址：www.baiyingfund.com

85) 名称：上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523（021-33635338）

公司网址：www.zhongzhengfund.com

86) 名称：嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层

5312-15单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

87) 名称：奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

88) 名称：南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

89) 名称: 北京植信基金销售有限公司  
注册地址: 北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67  
办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号  
法定代表人: 王军辉  
客服电话: 4006-802-123  
公司网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

90) 名称: 大连网金基金销售有限公司  
注册地址: 中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202  
办公地址: 中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2F  
法定代表人: 樊怀东  
客服电话: 4000-899-100  
公司网址: [www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

91) 名称: 东方财富证券股份有限公司  
注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼  
办公地址: 上海市宛平南路88号东方财富大厦16楼  
法定代表人: 郑立坤  
联系人: 周艳琼  
公司网址: [www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

客服热线: 95357  
92) 名称: 和耕传承基金销售有限公司  
注册地址: 河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼503  
办公地址: 河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼503  
法定代表人: 温丽燕  
客服电话: 400—0555—671  
公司网址: [www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

93) 名称: 泛华普益基金销售有限公司  
公司名称: 泛华普益基金销售有限公司  
注册地址: 成都市成华区建设路9号高地中心1101室  
办公地址: 广州市天河区珠江西路15号珠江城大厦42楼  
法定代表人: 于海锋

客服电话：028-8661-6229

公司网址：<https://www.puyifund.com/>

94) 名称：泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路甲92号-4至24层内10层1012

办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206

法定代表人：彭浩

客服电话：400-004-8821

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

95) 名称：北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A座

法定代表人：梁蓉

客服电话：010-66154828

公司网址：[corp.5irich.com](http://corp.5irich.com)

96) 名称：博时财富基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层

法定代表人：王德英

客服电话：400-610-5568

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

## (二) 注册登记机构

名称：宏利基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

法定代表人：高贵鑫

联系人：石楠

联系电话：010-66577769

传真：010-66577750

## (三) 律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼



注册地址：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

经办律师：廖海、刘佳

联系人：刘佳

（四）会计师事务所

法定名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心  
11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：顾俊懿

经办注册会计师：魏佳亮、顾俊懿

## 六、 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2019年10月29日经中国证监会证监许可[2019]2101号文募集注册。

一、基金运作方式

契约型开放式。

二、基金的类别

股票型证券投资基金。

三、标的指数

中证主要消费红利指数

#### 四、基金存续期限

不定期。

#### 五、基金的募集情况

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效认购户数为6,569户，净销售金额为人民币478,681,561.31元，折合基金份额478,681,561.31；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计人民币205,894.38元，折合205,894.38份基金份额归基金份额持有人所有，合计募集份额为478,932,455.69份。上述资金已于2020年3月24日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

### 七、基金合同的生效

#### 一、基金合同生效的条件

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3月26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。

#### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

### 八、基金份额的申购与赎回

#### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售

业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

## 二、申购和赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券交易所及相关金融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4月20日起开放日常申购、赎回业务。

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

## 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

## 四、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购申请成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成立。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。特殊情况下，基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人可与基金托管人协商，在法律法规规定的期限内向基金份额持有人支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至问题解决后的下一个工作日划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，由投资人自行承担由此造成的损失或不利后果。

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

## 五、申购和赎回的数量限制

1、通过基金管理人直销中心申购，单个基金账户单笔首次申购最低金额为10万元（含申购费），如在基金管理人直销中心有本基金认购记录的，则首次申购最低金额不受10万元限制；追加申购最低金额为1,000元（含申购费）；通过基金管理人网上直销系统进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为1元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销相关说明。通过其他销售机构申购，单个基金账户单笔申购最低金额为1元人民币（含申购费），销售机构有权在不低于上述规定的前提下，根据自身情况设置。

2、本基金对单个投资人累计持有的基金份额不设上限。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%且不存在通过一致行动人等方式变相规避50%集中度的情形（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

3、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足1份的，基金管理人有权一次将基金份额持有人在該交易账户保留的剩余基金份额全部赎回。

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

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

## 六、申购和赎回的费用及其用途

### 1、申购费用

本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用，C类基金份额在申购时不收取基金申购费用。投资者如果有多笔A类基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。本基金对通过直销中心申购A类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资

运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：1、全国社会保障基金；2、可以投资基金的地方社会保障基金；3、企业年金单一计划以及集合计划；4、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；5、企业年金养老金产品；6、职业年金计划；7、养老目标基金；8、个人税收递延型商业养老保险等产品。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

(1) 通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（M，含申购费）	养老金客户申购费率
M < 100 万元	0.30%
100 万元 ≤ M < 250 万元	0.20%
250 万元 ≤ M < 500 万元	0.125%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1,000 元/笔

(2) 本基金其他投资者（非养老金客户）申购本基金A类基金份额申购费率如下表：

申购金额（M，含申购费）	非养老金客户申购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 250 万元	0.80%
250 万元 ≤ M < 500 万元	0.50%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1,000 元/笔

本基金A类基金份额的申购费用应在投资者申购A类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金C类基金份额不收取申购费用，但收取销售服务费。C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。

## 2、赎回费用

本基金A类基金份额与C类基金份额设置不同的赎回费率。赎回费用由赎回各类基金份额的基金份额持有人承担。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金各类基金份额时收取，赎回费用扣除应归入基金财产的部分后，未归入基金财

产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

(1) 本基金A类基金份额赎回费率随赎回份额持有时间的增加而递减，详见下表：

	连续持有期限（日历日）	赎回费率	计入基金资产比例
A类基金 份额赎回 费	1天-6天	1.50%	100%
	7天（含）-179天	0.50%	25%
	180天（含）-365天	0.10%	25%
	366天（含）以上	0	0%

(2) 本基金C类基金份额赎回费率随赎回份额持有时间的增加而递减，详见下表：

	连续持有期限（日历日）	赎回费率	计入基金资产比例
C类基金份 额赎回费	1天-6天	1.50%	100%
	7天（含）-29天	0.50%	100%
	30天（含）以上	0%	-

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

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

6、法律、法规或监管部门另有规定的，从其规定。

七、申购和赎回的数额和价格

1、申购份额的计算

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日各类基金份额的基金份额净值为基准计算。

(1) A类基金份额的申购:

1) 若适用比例费率时, 申购A类基金份额的计算方法如下:

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

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

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

2) 若适用固定费用时, 申购A类基金份额的计算方法如下:

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

$$\text{申购费用} = \text{固定费用}$$

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

(2) C类基金份额的申购

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

(3) 上述计算结果均保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分四舍五入, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例1: 某投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金A类基金份额, 对应费率为1.20%, 假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0160元, 则其可得到的申购份额为:

$$\begin{aligned} \text{净申购金额} &= \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率}) = 50,000 / (1 + 1.20\%) \\ &= 49,407.11 \text{元} \end{aligned}$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额} = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 \text{元}$$

$$\begin{aligned} \text{申购份额} &= \text{净申购金额} / \text{申购当日A类基金份额的基金份额净值} \\ &= 49,407.11 / 1.0160 = 48,629.05 \text{份} \end{aligned}$$

即: 投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金A类基金份额, 假设申购当日A类基金份额净值为1.0160元, 则可得到48,629.05份A类基金份额。

例2: 若某投资者投资5万元申购本基金C类基金份额, 由于C类基金份额在申购时不收取基金申购费用, 假设申购当日C类基金份额的基金份额净值为1.0160元, 则其可得到的申购份额为:

$$\begin{aligned} \text{申购份额} &= \text{申购金额} / \text{申购当日C类基金份额的基金份额净值} \\ &= 50,000 / 1.0160 = 49,212.60 \text{份} \end{aligned}$$

即: 投资者投资5万元申购本基金C类基金份额, 假设申购当日C类基金份



额的基金份额净值为1.0160元，则可得到49,212.60份C类基金份额。

## 2、基金份额赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以赎回申请当日该类基金份额的基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额。

赎回金额=赎回份额×T日该类基金份额的基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例1：某投资者赎回本基金A类基金份额1万份，持有时间为200天，对应的赎回费率为0.10%，假设赎回当日A类基金份额的基金份额净值是1.1200元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.1200=11,200.00元

赎回费用=11,200.00×0.10%=11.20元

净赎回金额=11,200.00-11.20=11,188.80元

即：投资者赎回A类基金份额1万份，持有期限为200天，假设赎回当日A类基金份额的基金份额净值是1.1200元，则其可得到的赎回金额为11,188.80元。

例2：某投资者赎回本基金C类基金份额1万份，持有时间为20天，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.1200元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.1200=11,200.00元

赎回费用=11,200.00×0.50%=56.00元

净赎回金额=11,200.00-56.00=11,144.00元

即：投资者赎回C类基金份额1万份，持有期限为20天，假设赎回当日C类基金份额净值是1.1200元，则其可得到的赎回金额为11,144.00元。

3、本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。如相关法律法规以及中国证

监会另有规定，则依规定执行。

基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 8、指数编制机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。
- 9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。
- 10、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、6、7、8、10项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给

投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 十、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

(4) 若本基金发生巨额赎回的，单个开放日内在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额20%以上的赎回申请情形下，按以下两种情形处理：

①当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，基金管理人可以全部赎回；

②当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理赎回申请，具体措施如下：

a.对单个投资者超过前一开放日基金总份额20%的赎回申请和未超过前一开放日基金总份额20%的投资者的赎回申请分开设定当日赎回确认比例，前者设定的赎回确认比例不得高于对后者设定的赎回确认比例；

b.基金管理人在当日办理的赎回份额合计不得低于前一开放日基金总份额的10%，对其余赎回申请可以延期办理；

c.对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、若暂停时间超过1日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告增加次数。

#### 十二、基金转换

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

本基金已于2020年4月20日开放基金转换业务。具体实施方法详见相关公告。

#### 十三、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。

#### 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### 十五、基金的转托管

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

#### 十六、定期定额投资计划

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

本基金已于2020年4月20日起开放定期定额投资业务。具体实施方法详见相关公告。

#### 十七、基金的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规另有规定的除外。

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

十八、当技术条件成熟，本基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，可根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者办理基金份额的转让、过户等业务，届时无须召开基金份额持有人大会审议但须提前公告。

## 九、基金的标的指数

### 一、标的指数简介

中证主要消费红利指数采取股息率加权计算，旨在反映主要消费行业股息率较高证券的整体表现。

### 二、标的指数的编制方案

#### 1、指数名称和代码

中文全称	中证主要消费红利指数	英文全称	CSI Consumer Staples Dividend Index
指数代码	H30094		
发布日期	2013年7月2日	货币	人民币
基日	2005年12月30日	基值	1000

#### 2、样本空间

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

- 科创板证券：上市时间超过一年
- 其它证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前30位。
- 过去两年连续现金分红且每年的税后现金股息率均大于0；
- 过去一年日均总市值排名在前90%；
- 过去一年日均成交金额排名在前90%。

#### 3、指数选样方法

根据中证行业分类标准，对中证主要消费行业的证券，计算其过去两年的

平均税后现金股息率，并由高到低排名，选取排名在前30的证券作为指数样本；如果行业内证券数量不足30只，则全部证券作为相应行业红利指数样本。

#### 4、指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值=Σ(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见《中证指数有限公司股票指数计算与维护细则》。权重因子介于0和1之间，以使指数样本采用股息率加权且单个样本权重不超过15%。

#### 4、指数调整

##### (1) 定期调整

指数样本每年调整一次，样本调整实施时间为每年12月的第二个星期五的下一交易日。在新一轮样本调整中，首先将不满足以下条件的原样本依次剔除：

- (1) 行业属性没有发生变化；
- (2) 过去一年的税后现金股息率大于 0.5%；
- (3) 过去一年的日均总市值排名落在中证全指指数的样本空间的前90%；
- (4) 过去一年的日均成交金额排名落在中证全指指数的样本空间的前90%。

满足以上四个条件的原样本仍具有新一期样本空间的资格。

每次样本调整比例一般不超过20%，除非因行业属性发生变化或不满足过去一年的税后现金股息率大于0.5%而被首先剔除的原样本证券数量超过了20%。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

##### (2) 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。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《中证指数有限公司股票指数计算与维护细则》处理。

#### 5、指数发布



中证主要消费红利指数发布的官方渠道有：

(1) 通过中证指数有限公司数据服务平台每日对外发布；

(2) 通过中证指数有限公司官方网站（[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)）每日对外发布。

中证主要消费红利指数信息以上述官方发布结果为准。

### 三、指数信息的查阅方式

投资者可登录中证指数有限公司官方网站（[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)）免费查询指数信息及中证主要消费红利指数编制方案，也可拨打中证指数有限公司咨询电话（021-50185500）了解有关信息。

### 四、标的指数的更新

如指数编制方案发生了修订，本基金将在后续更新招募说明书中更新指数编制方案简述。

## 十、基金的投资

### 一、投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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：投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

### 三、投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

#### 1、资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金净资产90%的资产投资于标的指数成份股及备选成份股，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、衍生工具、债券资产、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具等，但需符合中国证监会的相关规定。

#### 2、成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据标的指数的股票权重构建股票资产组合，对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况下成份股无法安全按照指数权重进行组合构建时，将搭配使用其他合理方法进行适当替代。

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

此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。

### 3、股指期货投资策略

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

### 4、股票期权投资策略

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，采取备兑开仓、delta中性等策略适度参与股票期权投资。

5、对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

### 6、债券投资策略

本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。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，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

### 7、资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例证券的增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略，并按规定公告。

#### 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及其备选成份股的资产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) 本基金每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

(4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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

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

(10) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%，因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人

之外的因素致使基金不符合本项所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（13）本基金参与股指期货交易的，应当符合以下限制：

1）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%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值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；

3）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%；

4）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；

5）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%；

（14）本基金参与股票期权交易的，应当符合以下限制：

1）因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；

2）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3）未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（15）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市执行的股票执行，与境内上市执行的股票合并计算；

（16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（7）、（11）、（12）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。法律法规或监管部门另有规定的，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按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 五、标的指数及业绩比较基准

(一) 本基金的标的指数为：中证主要消费红利指数。

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。

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。

(二) 本基金的业绩比较基准：中证主要消费红利指数收益率×95%+银行活期存款利率（税收）×5%。

中证主要消费红利指数是由中证指数有限公司编制的，该指数采取股息率加权计算，旨在反映主要消费行业的红利水平。

如果指数编制机构变更或者停止上述指数的编制及发布，或者上述指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为本基金的标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，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（未经审计）

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

本基金托管人农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4月3日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2022年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、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	596,825,512.85	93.22
	其中：股票	596,825,512.85	93.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,199,176.85	3.94
	其中：债券	25,199,176.85	3.94
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,565,030.85	2.28
8	其他资产	3,616,328.10	0.56
9	合计	640,206,048.65	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合



## 2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	53,842,264.24	8.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	540,773,821.19	84.82
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	594,616,085.43	93.27

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,922,205.74	0.30
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,914.09	0.03
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	60,582.60	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	42,724.99	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,209,427.42	0.35

### 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 3.1 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	603886	元祖股份	2,011,200	39,459,744.00	6.19
2	600873	梅花生物	3,203,800	32,614,684.00	5.12
3	000895	双汇发展	1,151,081	29,847,530.33	4.68
4	002299	圣农发展	1,048,100	24,829,489.00	3.89
5	603968	醋化股份	893,800	19,422,274.00	3.05
6	603589	口子窖	320,600	18,489,002.00	2.90
7	603198	迎驾贡酒	293,861	18,448,593.58	2.89
8	600887	伊利股份	535,000	16,585,000.00	2.60
9	600598	北大荒	1,194,799	16,440,434.24	2.58
10	002304	洋河股份	94,514	15,169,497.00	2.38

### 3.2 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	688392	骄成超声	2,699	362,394.73	0.06
2	688041	海光信息	8,177	320,129.55	0.05
3	688141	杰华特	6,614	290,288.46	0.05
4	688403	汇成股份	19,217	194,920.04	0.03
5	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.02

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	国家债券	25,199,176.85	3.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,199,176.85	3.95

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	247,000	25,199,176.85	3.95

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

#### 6、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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

### 11.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 11.2 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

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,790.98
2	应收证券清算款	142,338.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,431,198.18
6	其他应收款	-

7	待摊费用	
8	其他	3,616,328.10
9	合计	42,790.98

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688392	骄成超声	362,394.73	0.06	新股流通受限
2	688041	海光信息	320,129.55	0.05	新股流通受限
3	688141	杰华特	290,288.46	0.05	新股流通受限
4	688403	汇成股份	182,332.04	0.03	新股流通受限
5	688084	晶品特装	140,118.75	0.02	新股流通受限

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

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

本基金合同生效日为2020年3月26日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

（一）截止2022年12月31日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

#### 消费红利指数A

阶段	基金净值收 益率①	基金净值收益 率标准差②	比较基准收 益率③	比较基准 收益率标 准差④	①—③	②—④
2020年3月26日 至2020年12月31 日	55.48%	1.44%	45.71%	1.58%	9.77%	-0.14%
2021年1月1日至 2021年12月31日	22.58%	1.27%	10.67%	1.31%	11.91%	-0.04%
2022年1月1日至 2022年12月31日	-5.65%	1.43%	-8.69%	1.45%	3.04%	-0.02%
基金合同生效以 来至2022年12月 31日	79.82%	1.38%	47.25%	1.44%	32.57%	-0.06%

#### 消费红利指数C

阶段	基金净值收益 率①	基金净值收 益率标准差 ②	比较基准收 益率③	比较基准收 益率标准差 ④	①—③	②—④
2020年3月26日 至2020年12月31 日	55.20%	1.44%	45.71%	1.58%	9.49%	-0.14%
2021年1月1日至 2021年12月31日	22.26%	1.27%	10.67%	1.31%	11.59%	-0.04%
2022年1月1日至 2022年12月31日	-5.88%	1.43%	-8.69%	1.45%	2.81%	-0.02%
基金合同生效以 来至2022年12月 31日	78.59%	1.38%	47.25%	1.44%	31.34%	-0.06%

本基金业绩比较基准：中证主要消费红利指数收益率×95%+银行活期存款

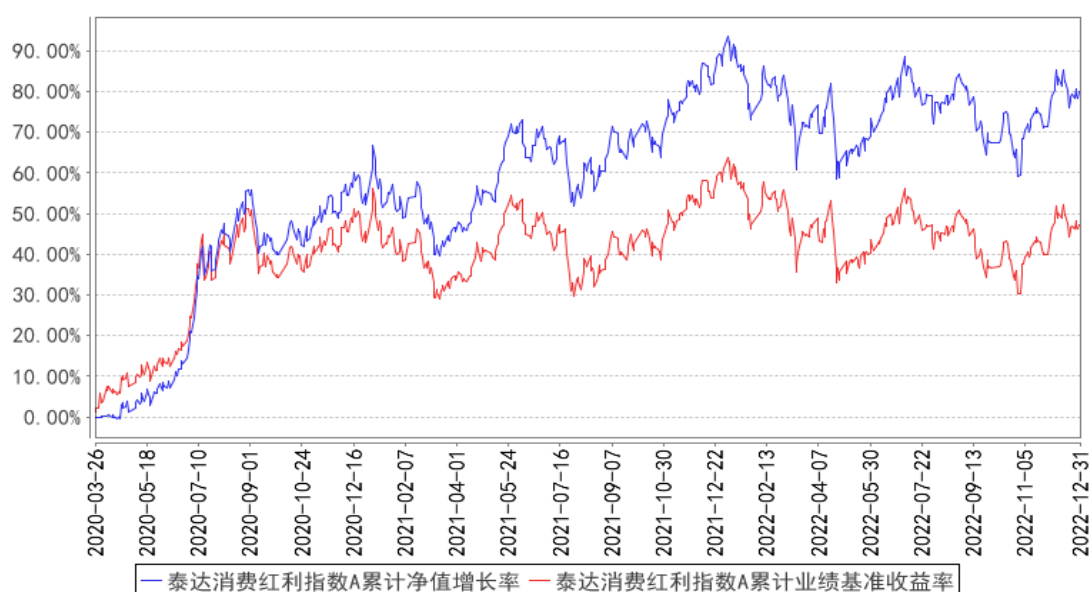
利率（税收）×5%。

中证主要消费红利指数是由中证指数有限公司编制的，该指数采取股息率加权计算，旨在反映主要消费行业的红利水平。

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

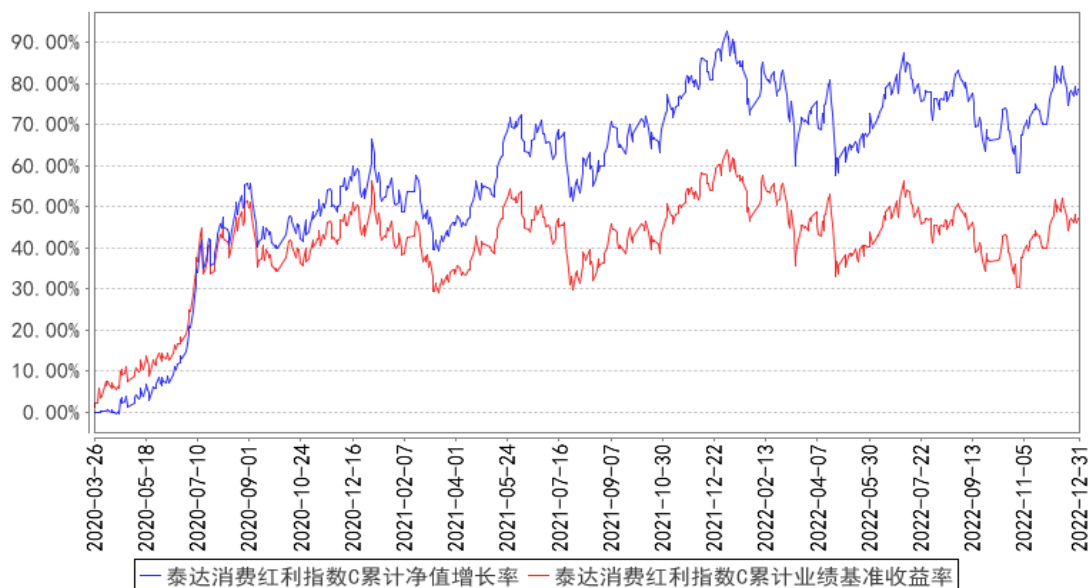
消费红利指数A基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2020年3月26日至2022年12月31日）

泰达消费红利指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



消费红利指数C基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2020年3月26日至2022年12月31日）

泰达消费红利指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

## 十二、基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由



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

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。但基金管理人、基金托管人有权收取的管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用除外。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十三、基金资产的估值

### 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、债券、股票期权和股指期货合约、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、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的

情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

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

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

7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值

价格数据。

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、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

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

## 五、估值程序

1、各类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该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

## 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。当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算

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

#### 九、特殊情况的处理

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，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十四、基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月

可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、由于本基金A类基金份额和C类基金份额认购/申购费用和销售服务费收取方式的不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致并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。

#### 四、收益分配方案

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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为同一类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十五、基金费用与税收

### 一、基金费用的种类



- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的指数许可使用费；
- 4、C类份额的销售服务费；
- 5、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（不包括自主披露产生的信息披露费用）；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费，因债券违约等事项进行追索产生的诉讼费、仲裁费、律师费由基金资产承担；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金相关账户的开户费用及账户维护费用；
- 9、基金的证券、期货交易费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日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、基金合同生效后的指数许可使用费

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每日计提指数许可使用费。在通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数许可方签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元（大写：伍万圆），计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

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使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新或相关公告中披露基金最新适用的方法。

### 4、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说

明。

销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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。

5、上述“一、基金费用的种类”中第5—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基

金财产账户直接缴付，或划付至管理人账户并自基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## 十六、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

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

## 十七、基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《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规定发生变化时，本基金从其最新规定。

## 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 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、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、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。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

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

基金合同终止的，除基金合同另有约定外，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

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

4、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指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在指定网站上。

关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自中国证监会规定之日起开始执行。

## （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指定网站上登载《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前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

### （四）基金份额申购、赎回价格

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

### （五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

#### （六）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指定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金收益分配事项；



15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、任一类别基金份额净值计价错误达该类别基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、调整基金份额类别；

24、本基金变更标的指数；

25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即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。

#### （八）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。

#### （九）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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告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。

#### （十一）投资股指期货相关公告

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

#### （十二）投资股票期权相关公告

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权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。

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

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

#### 七、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

若出现上述暂停或延迟披露基金信息的情形，基金管理人应及时向中国证监会报告，并与基金托管人协商采取补救措施。上述情形消失后，基金管理人和基金托管人应及时恢复办理信息披露。

#### 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住所，以供社会公众查阅、复制。

## 十八、风险揭示

本基金面临的主要风险有：

### 1、市场风险

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

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

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金将投资于股票、债券等金融工具，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

（4）购买力风险：基金的利润分配方式包含现金分红，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（5）债券收益率曲线变动风险：是指收益率曲线没有按预期变化导致基金投资决策出现偏差。

（6）再投资风险：该风险与利率风险互为消长。当市场利率下降时，基金所持有的债券价格会上涨，而基金将投资于债券类金融工具所得的利息收入进行再投资将获得较低的收益率，再投资的风险加大；反之，当市场利率上升时，基金所持有的债券价格会下降，利率风险加大，但是利息的再投资收益会上升。

（7）估值风险：本基金采用的估值方法有可能不能充分地反映和揭示利率风险，或经济环境发生了重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产的净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，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，使调整后的基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

(8) 经营风险：它与基金所投资证券的发行人的经营活动所引起的收入现金流的不稳定性有关。证券发行人期间运营收入变化越大，经营风险就越大；反之，运营收入越稳定，经营风险就越小。

## 2、信用风险

基金所投资债券的发行人如果不能或拒绝支付到期本息，或者不能履行合同规定的其他义务，或者其信用等级降低，将会导致债券价格下降，进而造成基金资产损失。

## 3、流动性风险

在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现。

### (1) 拟投资市场、行业和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（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等）。此外，本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险；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%。本基金是一只股票型指数基金，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%。本基金的标的指数为中证主要消费红利指数，该指数通过税后现金股息率、日均总市值和日均成交金额指标进行筛选，选出中证800指数样本股中的主要消费行业过去两年的平均税后现金股息率排名在前30名的股票组成成分股，整体流动性在A股市场中处于较高的水平。

### (2) 基金申购、赎回安排

投资者可以在开放式基金的开放日提出申购或赎回申请，但在极端的、特殊的市场情况下，可能无法满足投资者的日常申购或赎回申请。当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人将采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金申购、赎回安排的详细规则参见招募说明书第8部分。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在开放式基金申购、赎回过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能给基金仓位调整带来困难，产生流动性风险，甚至导致基金份额净值出现大幅波动。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回；同时，当基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过基金总份额一定比例以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。投资者将面临不能及时赎回或延缓获得赎回款项的可能。关于巨额赎回的详细规则参见招募说明书第8部分第十条。

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在确保投资者得到公平对待的前提下，基金管理人经与基金托管人协商，可依照法律法规及基金合同的规定，综合运用各类流动性风险管理工具作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价及中国证监会认定的其他措施。当实施流动性风险管理工具时，投资者有可能无法如期获得赎回款，或增加赎回成本。

#### 4、操作风险

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

#### 5、管理风险

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

#### 6、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反基金合同有关规定的风险。

7、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

## 8、本基金特有的风险

### （1）指数化投资风险

#### ①标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### ②标的指数波动的风险

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

#### ③基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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误差。

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生跟踪误差。

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

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪误差。

6) 其他因素产生的跟踪误差。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;因指数编制机构指数编制错误等,由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### ④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,基金的风险收益特征将与新的标的指数保持一致,投资者必须承担此项调整带来的风险与成本。

#### ⑤跟踪误差控制未达约定目标的风险

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

#### ⑥指数编制机构停止服务风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。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。

#### ⑦成份股停牌或违约的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份股停牌时,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) 股指期货和股票期权的投资风险

在衍生品市场中,本基金投资于股指期货或股票期权等金融工具,股指期



货、股票期权属于高风险投资工具，相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险。

股指期货的投资风险主要为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：1) 需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；2) 因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；3) 因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。同时在股指期货投资过程中还面对卖空风险（同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失）、杠杆风险（因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动）、平仓风险（在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓）等风险。

股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。基金管理人为了更好的防范投资股票期权所面临的各类风险，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项。

### （3）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。

（4）本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，若本基金投资存托凭证的，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制

相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 9、其他风险

(1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 因业务竞争压力可能产生的风险；

(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。

10、基金管理人职责终止风险：因违法经营或者出现重大风险等情况，可能发生基金管理人被依法取消基金管理资格或依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等情况。在基金管理人职责终止情况下，投资者面临基金管理人变更或基金合同终止的风险。基金管理人职责终止，涉及基金管理人、临时基金管理人、新任基金管理人之间责任划分的，相关基金管理人对各自履职行为依法承担责任。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人

和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

## 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，基金管理人或临时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依照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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》终止情形出现且基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十、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

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和收益分配等的业务规则；
- (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、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问依法合理要求提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有

关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失

的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户及其他投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问依法合理要求提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，



说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人权利和义务

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

件。

同一类别的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) 按照规定要求召开或者自行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、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (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) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调低销售服务费和调低除管理费、托管费外其他应由基金承担的费用；
- (3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整基金份额类别；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 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；

(6) 基金管理人、基金登记机构调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等内容；

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集或在法定时间内未能作出书面答复，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或在法定时间内未能作出书面答复，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或在法定时间内未能作出书面答复的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不

得阻碍、干扰。

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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大会通知载明的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会通知载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（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、在法律法规或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非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明；在会议召开方式上，在法律法规或监管机构允许的前提下，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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份

额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（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、中国证监会另有规定或《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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开



审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

(九) 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、基金收益与分配

#### (一) 基金利润的构成

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

#### (二) 基金可供分配利润

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

#### (三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、由于本基金A类基金份额和C类基金份额认购/申购费用和销售服务费收

取方式的不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致并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。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为同一类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的指数许可使用费；
- 4、C类份额的销售服务费；

5、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（不包括自主披露产生的信息披露费用）；

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费，因债券违约等事项进行追索产生的诉讼费、仲裁费、律师费由基金资产承担；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金相关账户的开户费用及账户维护费用；

9、基金的证券、期货交易费用；

10、基金的银行汇划费用；

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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日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、基金合同生效后的指数许可使用费

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每日计提指数许可使用费。在通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数许可方签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元（大写：伍万圆），计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

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使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新或相关公告中披露基金最新适用的方法。

#### 4、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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。

5、上述“（一）基金费用的种类”中第5—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至管理人账户并自基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## 五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

### （一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证

监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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:投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后变更基金投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。

### (三) 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及其备选成份股的资产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) 本基金每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

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

(4) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(5) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超

过该资产支持证券规模的10%；

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

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

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

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

(10) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的140%；

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

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

(13) 本基金参与股指期货交易的，应当符合以下限制：

1) 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%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值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；

3) 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%；

4) 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;

5) 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%;

(14) 本基金参与股票期权交易的,应当符合以下限制:

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;

2) 开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(15) 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(2)、(7)、(11)、(12)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。法律法规或监管部门另有规定的,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本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按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 六、基金净值的计算方法和公告方式

### (一) 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。

### (二) 基金净值信息的公告

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

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

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

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

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

## （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，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，基金管理人或临时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或临时基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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》终止情形出现且基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交仲裁。任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

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

#### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

办公地址：北京市朝阳区针织路23号楼中国人寿金融中心6层02-07单元

邮政编码：100033

法定代表人：高贵鑫

成立日期：2002年6月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002]37号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.8亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资

券、超短期融资券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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:投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后变更基金投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。

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

#### 1、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及其备选成份股的资产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)本基金每个交易日日终在扣除股票期权和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

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

(4)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

(6) 本基金管理人管理的、且由本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%；

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

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

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

(10) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的140%；

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

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

(13) 本基金参与股指期货交易的，应当符合以下限制：

1) 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%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值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；

3) 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%；

4) 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;

5) 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%;

(14) 本基金参与股票期权交易的,应当符合以下限制:

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;

2) 开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(15) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市执行的股票执行,与境内上市执行的股票合并计算;

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(7)、(11)、(12)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。法律法规或监管部门另有规定的,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按变更后的规定执行。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本协议第十五条第(十一)项基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规有关基金从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应

事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人有权向中国证监会报告。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行

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

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

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、流通受限证券与上文中流动性受限资产并不完全一致，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、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。

上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4.在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5.基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。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。

6.基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7.如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人提供相关数据或者提供了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在定期期

限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

### 三、基金管理人应履行对基金托管人的业务核查

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

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产的保管

##### (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。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、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，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人应予以必要的协助和配合，但对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出

具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金托管资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

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

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### （四）基金证券账户的开立和管理

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

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

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，

涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

### 五、基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

各类基金份额净值是指基金资产净值除以该类基金份额总数后得到的基金



份额的资产净值。各类基金份额净值的计算，均精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

## 2、复核程序

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进行估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

本基金的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、基金权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和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后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。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。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、适用法律与争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协

商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

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

## 八、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止的情形

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，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、基金投资者交易资料的对账服务

1. 基金投资者可登录本公司网站（[www.manulifefund.com.cn](http://www.manulifefund.com.cn)）查阅对账单。

2. 基金投资者也可向本公司定制纸质、电子或短信形式的定期或不定期对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

## 二、宏利基金网上直销系统

网上交易系统网址：<https://etrade.manulifefund.com.cn/etrading>

支持基金管理人旗下基金网上交易系统的银行卡和第三方支付有：农业银行卡、建设银行卡、民生银行卡、招商银行卡、兴业银行卡、中信银行卡、光大银行卡、交通银行卡、浦发银行卡、中国银行卡、广发银行卡和快钱支付等。

宏利基金微信公众账号：manulifefund\_BJ，支持民生银行卡、招商银行卡和快钱支付。

## 三、客服电话服务

基金管理人客服中心为投资者提供7×24小时的电话语音服务，投资者可通过客服电话4006988888/010-66555662的语音系统或登录公司网站[www.manulifefund.com.cn](http://www.manulifefund.com.cn)，查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间还将为投资者提供周到的人工答疑服务。

## 四、投诉建议受理

投资者可以拨打基金管理人客户服务中心电话 4006988888 /010-66555662 或客服信箱：[irm@manulifefund.com.cn](mailto:irm@manulifefund.com.cn) 向客服中心提交投诉和建议。

五、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十三、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

1. 本基金管理人已于2022年3月31日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金2021年年度报告》。

2. 本基金管理人已于2022年3月31日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下

基金2021年年度报告提示性公告》。

3. 本基金管理人已于2022年4月9日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金更新招募说明书》。

4. 本基金管理人已于2022年4月9日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新》。

5. 本基金管理人已于2022年4月9日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新》。

6. 本基金管理人已于2022年4月11日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加中宏人寿保险有限公司费率优惠活动的公告》。

7. 本基金管理人已于2022年4月13日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

8. 本基金管理人已于2022年4月20日发布《关于终止北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》。

9. 本基金管理人已于2022年4月20日发布《关于泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金新增国信证券股份有限公司为销售机构的公告》。

10. 本基金管理人已于2022年4月20日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参与天津银行股份有限公司申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告》。

11. 本基金管理人已于2022年4月22日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数证券投资基金2022年第1季度报告》。

12. 本基金管理人已于2022年4月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下基金2022年第1季度报告提示性公告》。

13. 本基金管理人已于2022年4月26日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司同业易管家平台申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告》。

14. 本基金管理人已于2022年4月30日发布《关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》。

15. 本基金管理人已于2022年5月19日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金转换业务申购补差费

优惠活动的公告》。

16. 本基金管理人已于2022年6月1日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加东方财富证券股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

17. 本基金管理人已于2022年6月3日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加北京银行股份有限公司申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告》。

18. 本基金管理人已于2022年6月23日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京雪球基金销售有限公司基金转换业务申购补差费优惠活动的公告》。

19. 本基金管理人已于2022年7月8日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加诺亚正行基金销售有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

20. 本基金管理人已于2022年7月14日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》。

21. 本基金管理人已于2022年7月21日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数证券投资基金2022年第2季度报告》。

22. 本基金管理人已于2022年7月21日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下基金2022年第2季度报告提示性公告》。

23. 本基金管理人已于2022年7月21日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加嘉实财富管理有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

24. 本基金管理人已于2022年7月21日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加泰信财富基金销售有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

25. 本基金管理人已于2022年7月29日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参与东莞银行股份有限公司申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告》。

26. 本基金管理人已于2022年8月4日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其申购（含定

期定额申购)费率优惠活动的公告》。

27. 本基金管理人已于2022年8月16日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告》。

28. 本基金管理人已于2022年8月31日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金2022年中期报告》。

29. 本基金管理人已于2022年8月31日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下基金2022年中期报告提示性公告》。

30. 本基金管理人已于2022年9月24日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加恒泰证券股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告》。

31. 本基金管理人已于2022年9月30日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加武汉伯嘉基金销售有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告》。

32. 本基金管理人已于2022年10月15日发布《泰达宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

33. 本基金管理人已于2022年10月20日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》。

34. 本基金管理人已于2022年10月20日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司并参加其申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告》。

35. 本基金管理人已于2022年10月25日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金新增光大银行股份有限公司为销售机构的公告》。

36. 本基金管理人已于2022年10月26日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数证券投资基金2022年第3季度报告》。

37. 本基金管理人已于2022年10月26日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下基金2022年第3季度报告提示性公告》。

38. 本基金管理人已于2022年11月9日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司同业与金融市场统一门户为销售机构的公告》。

39. 本基金管理人已于2022年11月17日发布《关于泰达宏利基金管理有限公

司旗下部分基金新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告》。

40. 本基金管理人已于2022年11月21日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

41. 本基金管理人已于2022年11月30日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于公司股东及实际控制人变更的公告》。

42. 本基金管理人已于2022年12月6日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告》。

43. 本基金管理人已于2022年12月24日发布《泰达宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

44. 本基金管理人已于2022年12月24日发布《泰达宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

45. 本基金管理人已于2022年12月24日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于董事变更的公告》。

46. 本基金管理人已于2023年1月11日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加国金证券股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

47. 本基金管理人已于2023年1月11日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加渤海证券股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

48. 本基金管理人已于2023年1月14日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加星展银行（中国）有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

49. 本基金管理人已于2023年1月17日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为销售机构的公告》。

50. 本基金管理人已于2023年1月18日发布《泰达宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金2022年第4季度报告》。

51. 本基金管理人已于2023年1月18日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告》。

52. 本基金管理人已于2023年1月18日发布《关于泰达宏利基金管理有限公

司旗下部分基金参加玄元保险代理有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

53. 本基金管理人已于2023年1月18日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加兴业银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

54. 本基金管理人已于2023年2月15日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加中山证券有限责任公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

55. 本基金管理人已于2023年2月17日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

56. 本基金管理人已于2023年3月3日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告》。

57. 本基金管理人已于2023年3月11日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告》。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，以供社会公众查阅、复制。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.manulifefund.com.cn](http://www.manulifefund.com.cn)）查阅和下载招募说明书。

## 二十五、备查文件

一、本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；



- 2、《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式

1、存放地点：备查文件第6项存放在基金托管人的住所；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

宏利基金管理有限公司

2023年9月9日