

# 华夏中证港股通内地金融交易型开放式 指数证券投资基金招募说明书（更新）

2024年6月28日公告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

## 重要提示

华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2023 年 7 月 6 日中国证监会许可[2023]1489 号文准予注册。本基金基金合同于 2023 年 9 月 25 日正式生效。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有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管理风险，本基金的特定风险等。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、成份股停牌等潜在风险。此外，本基金作为交易型开放式指数证券投资基金，特定风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、申购赎回清单差错风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购赎回失败的风险、申购赎回的代理买卖风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险等。本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），在上海证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券为香港交易所证券，基金份额的清算交收与境内普通 ETF 存在一定差异。通常情况下，投资者申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回。投资者认

购本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用基金账户只能参与本基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应使用 A 股账户。本基金以人民币募集和计价，本基金可投资于香港市场以港币计价的金融工具，人民币对港币的汇率的波动可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生一定影响。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金可投资于股票期权、股指期货、国债期货等金融衍生品，可能面临的风险包括市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、操作风险等。本基金可投资于资产支持证券，可能面临的风险包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。投资者应当认真阅读并完全理解基金合同第二十一部分规定的免责条款、第二十二部分规定的争议处理方式。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

投资者应当认真阅读并完全理解基金合同规定的免责条款和规定的争议处理方式。

本招募说明书年度更新有关财务数据和净值表现数据截止日为2024年3月31日（如本基金未披露2024年1季报，则本次更新暂无相关投资组合报告和业绩数据），主要人员情况截止日为2024年6月27日，其他所载内容截止日为2024年6月14日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 目录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                  | 4   |
| 二、释义.....                  | 5   |
| 三、基金管理人.....               | 9   |
| 四、基金托管人.....               | 18  |
| 五、相关服务机构.....              | 24  |
| 六、基金的募集.....               | 38  |
| 七、基金合同的生效.....             | 39  |
| 八、基金份额的申购与赎回.....          | 40  |
| 九、基金份额的上市交易.....           | 51  |
| 十、基金的投资.....               | 53  |
| 十一、基金的业绩.....              | 62  |
| 十二、基金的财产.....              | 63  |
| 十三、基金资产的估值.....            | 64  |
| 十四、基金的收益与分配.....           | 70  |
| 十五、基金的费用与税收.....           | 72  |
| 十六、基金的会计与审计.....           | 75  |
| 十七、基金的信息披露.....            | 76  |
| 十八、风险揭示.....               | 83  |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 93  |
| 二十、基金合同的内容摘要.....          | 95  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要.....       | 96  |
| 二十二、对基金份额持有人的服务.....       | 97  |
| 二十三、其他应披露事项.....           | 98  |
| 二十四、招募说明书存放及查阅方式.....      | 99  |
| 二十五、备查文件.....              | 99  |
| 附件一：基金合同摘要.....            | 101 |
| 附件二：基金托管协议摘要.....          | 124 |
| 附件三：标的指数编制方案.....          | 141 |

## 一、绪言

《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》依据《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）及其他有关规定以及《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。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为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。**基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。**

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义

- 1、基金或本基金：指华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金管理人：指华夏基金管理有限公司。
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司。
- 4、基金合同、《基金合同》：指《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充。
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充。
- 6、招募说明书：指《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新。
- 7、基金产品资料概要：指《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。
- 8、基金份额发售公告：指《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》。
- 9、上市交易公告书：指《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。
- 10、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。
- 11、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 12、《销售办法》：指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 13、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 14、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 15、《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。

16、《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。

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

18、联接基金：指将其绝大多数基金财产投资于本基金，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

20、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。

21、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。

22、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。

23、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，可以使用来自境外的资金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，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

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

25、港股通：指投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票。

26、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人。

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

28、销售机构：指直销机构和代销机构。

29、直销机构：指华夏基金管理有限公司。

30、代销机构：指发售代理机构和/或申购赎回代理机构。

- 31、发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。
- 32、申购赎回代理机构：指基金管理人指定的代理本基金申购、赎回业务的机构。
- 33、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人证券账户或基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务和基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。
- 34、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。
- 35、基金合同生效日：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。
- 36、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。
- 37、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。
- 38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限。
- 39、工作日：指上海证券交易所的正常交易日。
- 40、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。
- 41、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）。
- 42、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，本基金的开放日为港股通交易日。
- 43、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。
- 44、《业务规则》：指基金管理人、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、销售机构的相关业务规则和规定。
- 45、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为。
- 46、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。
- 47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为赎回对价的行为。
- 48、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。



49、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额和/或其他对价。

50、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的现金替代、现金差额和/或其他对价。

51、最小申购赎回单位：指基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍。

52、元：指人民币元。

53、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。

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

55、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

56、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。

57、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。

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

59、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。

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

61、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

设立日期：1998年4月9日

法定代表人：杨明辉

联系人：邱曦

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元，公司股权结构如下：

| 持股单位                            | 持股占总股本比例    |
|---------------------------------|-------------|
| 中信证券股份有限公司                      | 62.2%       |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 27.8%       |
| 天津海鹏科技咨询有限公司                    | 10%         |
| <b>合计</b>                       | <b>100%</b> |

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

张佑君先生：董事长、党委书记，硕士。现任中信证券股份有限公司党委书记、执行董事、董事长；兼任中信集团、中信股份及中信有限总经理助理，中信金控副董事长。曾任中信证券交易部总经理、襄理、副总经理，中信证券董事，长盛基金管理有限公司总经理，中信证券总经理，中信建投总经理、董事长，中信集团董事会办公室主任，中证国际有限公司董事，中信证券国际、中信里昂（即 CLSA B.V. 及其子公司）董事长，中信里昂证券、赛领资本管理有限公司董事，金石投资董事长，中信证券投资董事长等。

J Luke Gregoire Gould先生：董事，学士。现任迈凯希金融公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾任IGM Financial Inc. 的执行副总裁兼首席财务官、Mackenzie Investments的首席财务官、Investors Group的高级副总裁兼首席财务官等。

李星先生：董事，硕士。现任春华资本集团执行董事，负责春华在金融服务行业的投

资。曾任职于高盛集团北京投资银行部、春华资本集团分析师、投资经理等。

史本良先生：董事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司党委委员、执行委员、财富管理委员会主任、财富管理党委书记。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、总监、联席负责人、行政负责人、公司副财务总监、公司财务总监等。

李春波先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员、中信证券国际有限公司董事长、首席执行官。曾任中信证券研究部首席分析师，中信证券股票销售交易部B角（主持工作），中信证券研究部行政负责人，中信证券股票销售交易部行政负责人等。

李一梅女士：董事、总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委副书记。兼任华夏基金（香港）有限公司董事长，华夏股权投资基金管理（北京）有限公司执行董事、总经理。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理、数据中心行政负责人（兼），上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理，证通股份有限公司董事等。

刘霞辉先生：独立董事，硕士。现任中国社会科学院经济研究所国务院特殊津贴专家，二级研究员，博士生导师。兼任中国战略研究会经济战略专业委员会主任、山东大学经济社会研究院特聘兼职教授及广西南宁政府咨询专家。曾任职于国家人社部政策法规司综合处。

殷少平先生：独立董事，博士。现任中国人民大学法学院副教授、硕士生导师。曾任最高人民法院民事审判第三庭审判员、高级法官，湖南省株洲市中级人民法院副院长、审判委员会委员，北京同仁堂股份有限公司、河北太行水泥股份有限公司独立董事，广西壮族自治区南宁市西乡塘区政府副区长，北京市地石律师事务所兼职律师等。

伊志宏女士：独立董事，博士。教授，博士生导师，主要研究方向为财务管理、资本市场、消费经济，曾任中国人民大学副校长，中国人民大学商学院院长，中国人民大学法学院院长，享受国务院政府特殊津贴。兼任国务院学位委员会第七届工商管理学科评议组召集人、国务院学位委员会第八届工商管理学科评议组成员、第五届全国MBA教育指导委员会副主任委员、教育部工商管理专业教学指导委员会副主任委员、中国金融会计学会副会长、欧洲管理发展基金会（EFMD）理事会理事、国际高等商学院协会（AACSB）首次认证委员会委员。

侯薇薇女士：监事长，学士。现任鲍尔太平有限公司（Power Pacific Corporation Ltd）总裁兼首席执行官，兼任加拿大鲍尔集团旗下Power Pacific Investment Management董

事、投资管理委员会成员，加中贸易理事会国际董事会成员。曾任嘉实国际资产管理公司(HGI)的全球管理委员会成员、首席业务发展官和中国战略负责人等。

西志颖女士：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部行政负责人。曾任中信证券股份有限公司计划财务部统计主管、总账核算跨级主管、B角、B角（主持工作）等。

唐士超先生：监事，博士。现任中信证券股份有限公司风险管理部B角。曾在中信证券股份有限公司风险管理部从事风险分析、风险计量、市场风险和流动性风险管理等工作。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室执行总经理、行政负责人，董事会秘书。兼任证通股份有限公司董事。曾任中国证券报社会记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

郑煜女士：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委副书记、基金经理等。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理，原中信基金股权投资部总监，华夏基金管理有限公司总经理助理、纪委书记等。

孙彬先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、投资经理等。曾任华夏基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理、公司总经理助理等。

张德根先生：副总经理，硕士。曾任职于北京新财经杂志社、长城证券，曾任华夏基金管理有限公司深圳分公司总经理助理、副总经理、总经理，广州分公司总经理，上海华夏财富投资管理有限公司副总经理，华夏基金管理有限公司总经理助理、研究发展部行政负责人（兼）等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、纪委书记、法律部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人，合规部行政负责人等。

孙立强先生：财务负责人，硕士。现任华夏基金管理有限公司财务部行政负责人、华夏资本管理有限公司监事、上海华夏财富投资管理有限公司监事、华夏基金（香港）有限公司董事。曾任职于深圳航空有限责任公司计划财务部，曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角、财务部B角等。

桂勇先生：首席信息官，学士。兼任华夏基金管理有限公司金融科技部行政负责人。曾任职于深圳市长城光纤网络有限公司、深圳市中大投资管理有限公司，曾任中信基金管理有限责任公司信息技术部负责人，华夏基金管理有限公司信息技术部总经理助理、副总经理、行政负责人等。

## 2、本基金基金经理

司帆先生，硕士。2011年7月加入华夏基金管理有限公司，历任数量投资部研究员等，现任华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年7月6日起任职）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年7月6日起任职）、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年10月21日起任职）、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2021年10月21日起任职）、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年10月21日起任职）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2022年3月14日起任职）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2022年8月22日起任职）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2022年8月22日起任职）、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年8月22日起任职）、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年8月22日起任职）、华夏中证大数据产业交易型

开放式指数证券投资基金基金经理（2022年8月22日起任职）、华夏中证机床交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年10月12日起任职）、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023年3月27日起任职）、华夏恒生中国内地企业高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2023年4月11日起任职）、华夏中证机床交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2023年5月12日起任职）、华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023年9月25日起任职）、华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2024年1月3日起任职）、华夏中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2024年1月23日起任职）、华夏中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2024年4月19日起任职）、华夏中证新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2024年5月31日起任职）、投资经理。

### 3、本公司量化投资决策委员会成员

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司总经理助理，基金经理、投资经理。

成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理，基金经理。

袁英杰先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理、投资经理。

荣膺女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

孙蒙先生，华夏基金管理有限公司数量投资部高级副总裁，基金经理。

### 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度报告、中期报告和年度报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

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

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

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

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）法律、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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需另行召开基金份额持有人大会。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法

律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产。
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

#### 5、基金经理承诺

- （1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取利益。
- （2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

#### 1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

- （1）公司引入了独立董事制度，目前有独立董事 3 名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。
- （2）公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。
- （3）公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，并进行持续教育。



## 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

## 3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务流程的科学、合理和标准化，并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核；在岗位责任制度上，内部岗位分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置，相互检查、相互制约。

### （1）投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建，基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度，防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例；基金经理小组在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令，对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；交易管理部依据基金经理或基金经理授权的小组成员的指令负责交易执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线，交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定，对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控；风险管理部进行事中的监控；监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

## （2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

## （3）技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行，公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

## （4）人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

## （5）监察制度

公司设立了监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

## （6）反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构，指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作；各相关部门设立了反洗钱岗位，配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外，公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程，确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

## 4、信息沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化，不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

## 5、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门，通过定期或不定期检查，评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况，确保公司各项

经营管理活动的有效运行。

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。
- （2）上述关于内部控制的披露真实、准确。
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

### 四、基金托管人

#### （一）基金托管人概况

##### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：4006195555

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

##### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2024年03月31日，本集团总资产115,202.26亿元人民币，高级法下资本充足率18.20%，权重法下资本充足率15.01%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务

团队 10 个职能团队，现有员工 218 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行之一，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、保险资金托管、基本养老保险基金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人、私募基金业务外包服务等业务资格。

招商银行资产托管结合自身在托管行业深耕 22 年的专业能力和创新精神，推出“招商银行托管+”服务品牌，以“践行价值银行战略，致力于成为服务更佳、科技更强、协同更好的客户首选全球托管银行”品牌愿景为指引，以“值得信赖的专家、贴心服务的管家、让价值持续增加、客户的体验更佳”的“4+目标”，以创新的“服务产品化”为方法论，全方位助力资管机构实现可持续的高质量发展。招商银行资产托管围绕资管全场景，打造了“如风运营”“大观投研”“见微数据”三个服务子品牌，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6S”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，近年来获得业内各类奖项荣誉。2016 年 5 月“托管通”荣获《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；7 月荣获中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”、《21 世纪经济报道》“2016 最佳资产托管银行”。2017 年 5 月荣获《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”。2018 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖；同月，托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣获《中国基金报》“最佳基金托管银行”奖；5 月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣获 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12 月荣获

2019 东方财富风云榜“2019 年度最佳托管银行”奖。2020 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2019 年度优秀资产托管机构”奖项；6 月荣获《财资》“中国境内最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10 月荣获《中国基金报》第二届中国公募基金英华奖“2019 年度最佳基金托管银行”奖。2021 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2020 年度优秀资产托管机构”奖项；同月荣获 2020 东方财富风云榜“2020 年度最受欢迎托管银行”奖项；2021 年 10 月，《证券时报》“2021 年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021 年 12 月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020 年度最佳基金托管银行”；2022 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021 年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”奖项；9 月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖；12 月荣获《证券时报》“2022 年度杰出资产托管银行天玑奖”；2023 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2022 年度优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司“2022 年度优秀托管机构”、全国银行间同业拆借中心“2022 年度银行间本币市场托管业务市场创新奖”三项大奖；2023 年 4 月，荣获《中国基金报》第二届中国基金业创新英华奖“托管创新奖”；2023 年 9 月，荣获《中国基金报》中国基金业英华奖“公募基金 25 年基金托管示范银行（全国性股份行）”；2023 年 12 月，荣获《东方财富风云榜》“2023 年度托管银行风云奖”。2024 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2023 年度优秀资产托管机构”、“2023 年度估值业务杰出机构”、“2023 年度债市领军机构”、“2023 年度中债绿债指数优秀承销机构”四项大奖；2024 年 2 月，荣获泰康养老保险股份有限公司“2023 年度最佳年金托管合作伙伴”奖。

## （二）主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，本行党委书记、执行董事、行长。中国人民大学经济学硕士，高级经济

师。1995年6月加入本行，历任本行北京分行行长助理、副行长、行长，2012年6月起历任本行行长助理、副行长、常务副行长，2022年4月18日起全面主持本行工作，2022年5月19日起任本行党委书记，2022年6月15日起任本行行长。兼任本行香港上市相关事宜之授权代表、招银国际金融控股有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招商永隆银行董事长、招联消费金融有限公司副董事长、招商局金融控股有限公司董事、中国支付清算协会副会长、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事、广东省第十四届人大代表。

王颖女士，本行副行长，南京大学政治经济学专业硕士，经济师。王颖女士1997年1月加入本行，历任本行北京分行行长助理、副行长，天津分行行长，深圳分行行长，本行行长助理。2023年11月起任本行副行长。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001年8月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有20余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2024年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管1432只证券投资基金。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

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

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

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

### 3、内部控制原则

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

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

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

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

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

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

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

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

### 4、内部控制措施

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

三层制度体系，即：基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确，满足风险管理全覆盖的要求，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

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

（3）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

（4）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

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

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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



## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、申购赎回代办证券公司

##### （1）国泰君安证券股份有限公司

住所：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

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：黄博铭

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

客户服务电话：95521

##### （2）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区光华路10号

法定代表人：王常青

传真：010-65182261

联系人：权唐

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

客户服务电话：95587、4008-888-108

##### （3）国信证券股份有限公司

住所：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

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：于智勇

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

客户服务电话：95536

（4）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

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

客户服务电话：95565

（5）广发证券股份有限公司

住所：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：广州市天河区马场路26号广发证券大厦36楼

法定代表人：林传辉

电话：020-66336146

传真：020-87555417

联系人：陈姗姗

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

客户服务电话：95575

（6）中信证券股份有限公司

住所：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

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：郑慧

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

客户服务电话：95548

（7）中国银河证券股份有限公司

住所：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：王晟

电话：010-80928123

传真：010-66568990

联系人：辛国政

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

客户服务电话：4008-888-888或95551

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路689号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号

法定代表人：周杰

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

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

客户服务电话：95553、400-888-8001

（9）申万宏源证券有限公司

住所：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（200031）

法定代表人：杨玉成

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：余洁

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

客户服务电话：95523、400-889-5523

（10）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

传真：021-38565955

联系人：乔琳雪

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

客户服务电话：95562

（11）国投证券股份有限公司

住所：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：段文务

电话：0755-81688000

传真：0755-81688090

联系人：陈剑虹

网址：<http://www.essence.com.cn/>

客户服务电话：95517

（12）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼

法定代表人：高振营

电话：021-50295432

传真：021-68865680

联系人：江恩前

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

客户服务电话：95351

（13）万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层

法定代表人：袁笑一

电话：020-38286588

传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

网址：www.wlzq.cn

客户服务电话：95322

（14）民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

法定代表人：冯鹤年

电话：010-85127609

传真：010-85127641

联系人：韩秀萍

网址：www.msza.com

客户服务电话：95376

（15）渤海证券股份有限公司

住所：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

电话：022-23861683

传真：022-28451892

联系人：陈玉辉

网址：www.ewww.com.cn

客户服务电话：956066

（16）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

客户服务电话：95573

（17）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省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：肖海峰

电话：0532-85725062

传真：0532-85022605

联系人：赵如意

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

客户服务电话：95548

（18）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

网址：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

客户服务电话：95309

（19）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

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

客户服务电话：95330

（20）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：肖林

电话：010-83252185

传真：010-63080978

联系人：付婷

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（21）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（22）长城证券股份有限公司

住所：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：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

法定代表人：曹宏

电话：0755-83530715

传真：0755-83515567

联系人：梁浩

网址：www.cgws.com

客户服务电话：95514、400-6666-888

（23）光大证券股份有限公司

住所：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

电话：021-22169999

联系人：郁疆

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（24）中信证券华南股份有限公司

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

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

法定代表人：陈可可

电话：020-88834780

传真：020-88836914

联系人：郭杏燕

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：95548

（25）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：95360

（26）浙商证券股份有限公司

住所：杭州市江干区五星路201号

办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼

法定代表人：吴承根



电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

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

客户服务电话：95345

（27）平安证券股份有限公司

住所：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：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：何之江

电话：13916661875

传真：021-33830395

联系人：王阳

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

客户服务电话：95511-8

（28）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：范超

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

客户服务电话：95318

（29）东海证券股份有限公司

住所：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

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

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

客户服务电话：95531、400-888-8588

（30）国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼

法定代表人：徐丽峰

电话：0791-86283372、15170012175

传真：0791-86281305

联系人：占文驰

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

客户服务电话：956080

（31）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-58124967

传真：028-86150040

联系人：谢国梅

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

客户服务电话：95584

（32）申万宏源西部证券有限公司

住所：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（830002）

法定代表人：王献军

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：梁丽

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

客户服务电话：95523、400-889-5523

（33）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：王洪

电话：021-20315719

传真：021-20315125

联系人：张峰源

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

客户服务电话：95538

（34）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

客户服务电话：95372

（35）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

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

客户服务电话：95547

（36）中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

联系人：胡芷境

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

客户服务电话：400-600-8008、95532

（37）东方财富证券股份有限公司

住所：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号

法定代表人：戴彦

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：<http://www.18.cn>

客户服务电话：95357

（38）江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

联系人：姜志伟

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

客户服务电话：956007

（39）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

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

客户服务电话：95310

（40）华宝证券股份有限公司

住所：上海市陆家嘴环路166号27楼

办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

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

客户服务电话：400-820-9898

（41）长城国瑞证券有限公司

住所：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层

办公地址：福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼

法定代表人：王勇

电话：0592-2079259

传真：0592-2079602

联系人：邱震

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

客户服务电话：400-0099-886

（42）财达证券股份有限公司

住所：河北省石家庄市桥西区35号

办公地址：河北省石家庄市桥西区35号庄家金融大厦23-36层

法定代表人：翟建强

电话：0311-66008561

传真：0311-66006334

联系人：李卓颖

网址：www.s10000.com

客户服务电话：95363（河北省内）、0311-95363（河北省外）

（43）华金证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层

法定代表人：宋卫东

电话：021-20655562

联系人：龙莹

网址：<https://www.huajinsc.cn/>

客户服务电话：956011

（44）联储证券股份有限公司

住所：山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层

法定代表人：吕春卫

电话：010-86499838

传真：010-86499401

联系人：王龙

网址：<http://www.lczq.com>

客户服务电话：956006

2、本公司可以根据情况变化增加或者减少销售机构。基金销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

## （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

（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

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

经办律师：刘佳、吴卫英

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、王海彦

## 六、基金的募集

### （一）基金募集情况

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2023 年 7 月 6 日中国证监会许可[2023]1489 号文注册。

本基金自 2023 年 8 月 28 日起至 2023 年 9 月 19 日（含）进行发售。募集期间，本基

金共募集 208,936,000 份基金份额，有效认购户数为 1,348 户。

（二）基金类型、运作方式和存续期间

- 1、基金的类别：股票型证券投资基金。
- 2、基金的运作方式：交易型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

（三）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

## 七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2023 年 9 月 25 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。

《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 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。

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

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

### （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，本基金的开放日为港股通交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所的交易时间。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或实际情况需要，基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已自 2023 年 10 月 11 日起开放日常申购、赎回业务。

### （三）申购和赎回的原则

1、基金采用“份额申购、份额赎回”原则，即申购、赎回均以份额申请。

2、基金的申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定。

5、本基金申购、赎回的币种为人民币。基金管理人可以根据市场情况，在履行适当的程序后，增加新的销售币种，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资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。

投资人申购基金份额时，必须根据相应的申购赎回清单备足申购对价。基金份额持有人在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

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

## 2、申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。投资者申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回。投资者可通过其办理申购、赎回业务的销售机构或者销售机构规定的其他方式查询确认情况。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。

本基金申购业务采用实时逐笔全额结算（Real Time Gross Settlement，以下简称 RTGS）模式；赎回业务涉及的现金替代可采用代收代付处理；申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款可采用代收代付处理。

### 1) 申购的清算交收

投资者 T 日现金申购后，如交易记录已勾单且申购资金足额的，登记机构在 T 日日间实时办理基金份额及现金替代的交收；T 日日间未进行勾单确认或日间资金不足的，登记机构在 T 日日终根据资金是否足额办理基金份额及现金替代的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。基金管理人在 T+2 日内办理现金差额的交收。

### 2) 赎回的清算交收

投资者 T 日赎回申请受理后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算交收。基金管理人在 T+2 日内通过登记机构的代收代付平台办理现金差额的交收。

正常情况下，基金管理人不迟于 T+7 日（指开放日）办理赎回替代款项的交付。但如果出现基金投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足或其他原因导致无法足额卖出，则赎回对价的清算交收可延迟办理。

对于因申购赎回代理券商交收资金不足，导致投资者现金申购失败的情形，按照申购赎回代办券商的相关规则处理。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

4、基金管理人、上海证券交易所和登记机构可在法律法规允许的范围内，对基金份额持有人利益不存在实质不利影响的前提下，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

#### （五）申购和赎回的数额限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。目前，本基金最小申购、赎回单位为 100 万份。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。

2、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数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。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### （六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 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。

2、申购、赎回的对价及费用

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

（2）T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下对申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告，无须召开基金份额持有人大会。

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

#### （七）申购赎回清单的内容与格式

##### 1、申购赎回清单的内容

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

##### 2、组合证券相关内容

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

##### 3、现金替代相关内容

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

（1）现金替代分为2种类型：必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，基金管理人按照固定现金替代金额与投资者进行结算。

退补现金替代是指在申购、赎回基金份额时，允许使用现金作为该成份证券的替代，基金管理人按照申购赎回清单要求，代理投资者买入或卖出证券，并与投资者进行相应结算。

##### （2）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证

券；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后 T 日开盘参考价（需按照 T-1 日中国人民银行公布的人民币对港币的汇率中间价调整为人民币价格）。

### （3）退补现金替代

①适用情形：基金管理人认为需要在投资者申购或赎回时代投资者买入或卖出证券。

②替代金额：

对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额=替代证券数量×该证券 T 日开盘参考价×T-1 日中国人民银行公布的人民币对港币的汇率中间价×（1+申购现金替代溢价比例）。

收取现金替代溢价的原因是，基金管理人需要在收到申购确认信息后，在香港市场买入组合证券，实际结算成本与替代金额可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的替代金额高于购入该部分证券的实际结算成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的替代金额低于购入该部分证券的实际结算成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

#### 【1】申购替代金额的处理程序

基金管理人在 T 日内以收到的替代金额代投资者买入被替代证券。T 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用）和未买入的被替代证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代金额确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

正常情况下，T 日后的第 2 个港股通交易日后的 2 个工作日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况下，组合证券的代理买入及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

## 【2】赎回替代金额的处理程序

T 日内，基金管理人根据赎回规模进行被替代证券的代理卖出。T 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。

正常情况下，T 日后的第 3 个港股通交易日后的第 2 个工作日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇港股通临时停市等特殊情况下，组合证券的代理卖出及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

④未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或上海证券交易所、登记机构 ETF 申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对退补现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。

⑤基金管理人可以根据具体情况，调整上述替代金额的处理程序、规则等，并在招募说明书更新及其他公告中披露。

## 4、预估现金部分相关内容

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

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

T 日预估现金部分 = T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 (开盘参考价需按照 T-1 日中国人民银行公布的人民币对港币的汇率中间价调整为人民币价格))

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

#### 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额 = T 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与相应证券 T 日收盘价相乘之和 (收盘价需按照 T 日中国人民银行最新公布的人民币对港币的汇率中间价调整为人民币价格))

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

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

#### 6、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

| <b>基本信息</b>         |            |
|---------------------|------------|
| 最新公告日期              | (T 日)      |
| 基金名称                | X          |
| 基金管理公司名称            | 华夏基金管理有限公司 |
| 一级市场基金代码            | X          |
| <b>(T-1 日) 信息内容</b> |            |
| 现金差额 (单位: 元)        | X          |

| 最小申购赎回单位资产净值（单位：元） |      |      |        |            |            |      | X |
|--------------------|------|------|--------|------------|------------|------|---|
| 基金份额净值（单位：元）       |      |      |        |            |            |      | X |
| <b>（T日）信息内容</b>    |      |      |        |            |            |      |   |
| 预估现金部分（单位：元）       |      |      |        |            |            |      | X |
| 可以现金替代比例上限         |      |      |        |            |            |      | X |
| 是否需要公布 IOPV        |      |      |        |            |            |      | X |
| 最小申购赎回单位（单位：份）     |      |      |        |            |            |      | X |
| 申购、赎回的允许情况         |      |      |        |            |            |      | X |
| <b>（T日）成份股信息内容</b> |      |      |        |            |            |      |   |
| 股票代码               | 股票简称 | 股票数量 | 现金替代标志 | 申购现金替代溢价比例 | 赎回现金替代折价比例 | 替代金额 |   |
| X                  | X    | X    | X      | X          | X          | X    | X |

注：以上申购赎回清单仅为示例，具体以实际公布的为准。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 7、相关证券交易所、期货交易所、登记机构、申购赎回代理机构、基金管理人等因异常情况无法办理申购业务。
- 8、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
- 9、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。
- 10、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。



11、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

12、法律法规规定或中国证监会、上海证券交易所认定的其他情形。

发生上述第 1-3、5-12 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。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对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价。

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

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

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

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

6、相关证券交易所、期货交易所、登记机构、申购赎回代理机构、基金管理人等因异常情况无法办理赎回业务。

7、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

8、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。

9、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

10、发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

11、法律法规规定或中国证监会、上海证券交易所认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）其他申购赎回方式

1、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

2、ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出联接基金，联接基金可以特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

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

4、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议并公告。

5、基金管理人可以根据具体情况，履行适当程序后，开通本基金的场外申购、赎回等相关业务，而无需召开基金份额持有人大会。场外申购、赎回的具体安排及规则等相关事项届时将另行公告。

（十一）基金份额折算

为提高交易便利或根据需要（如变更标的指数），基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算后，基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（除因尾数处理而产生的损益外）。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

（十二）基金份额的转托管、非交易过户、质押、冻结与解冻等其他业务

基金登记机构可依据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（十三）基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

（十四）基金清算交收与登记模式的调整或新增

若上海证券交易所和中国证券登记结算有限公司针对交易型开放式证券投资基金调整或推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的招募说明书予以更新，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金在上海证券交易所的上市

经向上海证券交易所申请，本基金自 2023 年 10 月 11 日起在上海证券交易所上市交易。

### （二）基金在上海证券交易所的交易

基金在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### （三）基金份额参考净值（IOPV）的计算

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。参考净值的具体计算方法如下：

#### 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额（最新成交价按照人民币对港币的汇率调整为人民币价格）。

其中人民币对港币的汇率目前采用实时汇率公允价。汇率公允价包括中证指数公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价）等。

#### 2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

#### 3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

### （四）基金在上海证券交易所终止上市交易的情形

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

- 1、不再具备本条第一款规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，而无需召开基金份额持有人大会。届时，基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回业务规则。基金变更的具体安排见基金管理人届时发布的相关公告。

（五）相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定及业务规则内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

（六）若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会。

（七）在不违反法律法规的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

（八）法律法规、监管部门或上海证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含存托凭证、科创板、创业板、港股通标的股票及中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

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

### （三）投资策略

本基金采用完全复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 1、完全复制策略

本基金采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

#### 2、替代性策略

在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数

的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

### 3、存托凭证投资策略

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、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。

### 4、衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生品。

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

基金参与股票期权交易，应当按照风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

### 5、债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

### 6、资产支持证券投资策略

本基金将选择相对价值低估的资产支持证券类属或个券进行投资，并通过期限和品种的分散投资降低组合投资资产支持证券的信用风险、提前偿付风险、利率风险和流动性风险等。同时，依靠纪律化的投资流程和一体化的风险预算机制控制并提高投资组合的风险调整收益。

## 7、融资、转融通证券出借业务投资策略

本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。

利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。

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

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标及本基金风险收益特征的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （6）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值



的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

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

（10）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；

（11）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（12）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（13）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（14）基金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%；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；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）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

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

（17）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借

证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

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

（19）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（6）、（9）、（10）、（17）情形之外，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、港股通额度不足等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述（17）规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）向其基金管理人、基金托管人出资；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）法律、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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需另行召开基金份额持有人大会。

#### （五）标的指数与业绩比较基准

1、本基金标的指数为中证港股通内地金融指数。

本基金业绩比较基准为经估值汇率调整后的中证港股通内地金融指数收益率。

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

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

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

#### 2、中证港股通内地金融指数

指数编制方案请参见本招募说明书附件，投资者可通过以下路径查询指数信息：

<https://www.csindex.com.cn>

#### （六）风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

（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；

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）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2024 年第 1 季度报告：

5.1 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              | 50,433,801.17 | 97.82        |
|    | 其中：股票             | 50,433,801.17 | 97.82        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |

|   |              |               |        |
|---|--------------|---------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,124,780.53  | 2.18   |
| 8 | 其他资产         | -             | -      |
| 9 | 合计           | 51,558,581.70 | 100.00 |

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 50,433,801.17 元，占基金资产净值比例为 97.96%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 金融     | 48,770,390.71 | 94.73        |
| 工业     | 1,663,410.46  | 3.23         |
| 保健     | -             | -            |
| 必需消费品  | -             | -            |
| 材料     | -             | -            |
| 房地产    | -             | -            |
| 非必需消费品 | -             | -            |
| 公用事业   | -             | -            |
| 能源     | -             | -            |
| 通讯服务   | -             | -            |
| 信息技术   | -             | -            |
| 合计     | 50,433,801.17 | 97.96        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 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

| 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  | 01398 | 工商银行 | 2,172,000 | 7,757,964.80 | 15.07        |
| 2  | 00939 | 建设银行 | 1,793,000 | 7,672,096.39 | 14.90        |
| 3  | 03988 | 中国银行 | 2,157,000 | 6,316,033.57 | 12.27        |
| 4  | 02318 | 中国平安 | 192,000   | 5,752,603.68 | 11.17        |
| 5  | 03968 | 招商银行 | 118,500   | 3,324,840.12 | 6.46         |
| 6  | 01288 | 农业银行 | 860,000   | 2,572,788.90 | 5.00         |
| 7  | 03328 | 交通银行 | 490,000   | 2,283,236.83 | 4.43         |

|    |       |      |         |              |      |
|----|-------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 02328 | 中国财险 | 194,000 | 1,814,985.62 | 3.53 |
| 9  | 02628 | 中国人寿 | 208,000 | 1,770,600.94 | 3.44 |
| 10 | 00267 | 中信股份 | 244,000 | 1,663,410.46 | 3.23 |

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.10.2 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投资。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，农业银行、中国银行、建设银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

#### 5.11.4 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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

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

| 阶段                     | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2023年9月25日至2023年12月31日 | -6.25%   | 1.21%       | -7.09%     | 1.29%         | 0.84%  | -0.08% |
| 2024年1月1日              | -0.04%   | 1.49%       | 1.30%      | 1.53%         | -1.34% | -0.04% |

|  |        |       |        |       |        |        |
|--|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 日至 2024 年 3<br>月 31 日                  |        |       |        |       |        |        |
| 自基金合同生<br>效起至今<br>(2024 年 3 月<br>31 日) | -6.29% | 1.34% | -5.88% | 1.40% | -0.41% | -0.06% |

## 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、基金应收申购款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、期货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、证券/期货经纪机构、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、证券/期货经纪机构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、证券/期货经纪机构、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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



### 十三、基金资产的估值

#### （一）估值日

本基金的估值日为沪深证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

#### （二）估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、银行存款本息、应收款项、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、其他投资等资产及负债。

#### （三）估值原则

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

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

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

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

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

#### （四）估值方法

1、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。

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。

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

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估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行

间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

#### 4、存款的估值方法

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。

#### 5、投资证券衍生品的估值方法

（1）因持有港股通股票而享有的供股权，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（2）股指期货合约和国债期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

（3）本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金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、本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

9、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。

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

11、基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

12、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

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

### （五）估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

### （六）估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

(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。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告, 由此给基金份额持有人造成损失的, 应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金, 就实际向投资

者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

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

（4）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他情形。

#### （八）基金净值的确认

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

#### （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 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、证券/期货经纪机构、指数编制机构及第三方估值机构等第三方机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十四、基金的收益与分配

### （一）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上，可进行收益分配；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配采用现金方式；
- 6、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无重大实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### （二）基金收益分配数额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 100%；标的指数累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金累计报酬率超过标的指数累计报酬率的差额，当差额超过 1%时，基金可以进行收益分配。

期间如发生基金份额折算或拆分，则以基金份额折算或拆分日为初始日重新计算上述指标。

- 2、根据前述收益分配原则确定收益分配数额。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办

法》的有关规定在规定媒介公告。

（五）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。



## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金运作费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《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；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券/期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资费、转融通费用、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）基金上市初费及年费；
- （9）基金收益分配中发生的费用；
- （10）基金的开户费用、账户维护费用；
- （11）因投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票而产生的各项合理费用；
- （12）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。

#### 2、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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工

作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## （2）基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类”中第（3）—（12）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。

## （二）基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的“（六）申购和赎回的对价、费用及其用途”中的相关规定。

## （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、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；
- 5、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

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金

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

## 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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，

按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 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。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政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应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定媒介披露，并保证投资者能够按照《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：

#### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金

认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

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

## 4、基金份额上市交易公告书

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

## 5、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每

周在规定网站披露一次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，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### 6、基金份额申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人将在每个开放日通过网站或其他媒介公告当日的申购赎回清单。

#### 7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

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

#### 8、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，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影

响的下列事件：

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）基金终止上市交易、《基金合同》终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长或提前结束募集；
- （9）基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- （11）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- （12）基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- （13）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- （14）基金收益分配事项；
- （15）管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （16）基金份额净值计价错误达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）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- （19）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；



- (20) 基金变更标的指数；
- (21) 基金暂停上市、恢复上市；
- (22) 基金份额的折算及变更登记；
- (23) 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。

#### 9、澄清公告

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

#### 10、清算报告

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

#### 11、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。

#### 12、投资资产支持证券的相关公告

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

#### 13、投资股指期货的相关公告

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）等文件中披露的股指期货交易情况，应当包括投资政策、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本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。

#### 14、投资国债期货的相关公告

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）等文件中披露的国债期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本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。

#### 15、投资股票期权的相关公告

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等。

#### 16、投资流通受限证券的相关公告

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

#### 17、参与融资、转融通证券出借业务的相关公告

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

#### 18、投资港股通标的股票相关公告

本基金应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 19、中国证监会规定的其他信息。

##### （六）信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定以及证券交易所的自律管理规则。

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

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

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

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的主要风险

本基金将主要面临以下风险，其中部分或全部风险因素可能对基金份额净值、收益率、和/或实现投资目标的能力造成影响。

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。

（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：随着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。本基金主要投资于股票，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。

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

（5）再投资风险：再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

#### 2、港股投资风险

本基金通过港股通投资于港股，会面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

##### （1）海外市场风险

本基金在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

香港市场风险与内地A股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。加

之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比A股更为剧烈的股价波动。

#### （2）股价波动较大的风险

港股市场实行T+0回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比A股更为剧烈的股价波动，本基金的波动风险可能相对较大。

#### （3）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，存在港股通交易日不连贯（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应，造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

#### （4）港股通交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行T+2日（T日买卖股票，资金和股票在T+2日才进行交收）的交收安排，通过港股通在T日（港股通交易日）卖出股票，T+2日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）在香港市场完成清算交收，卖出的资金在T+3日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，造成支付赎回款日期比正常情况延后的风险。

#### （5）港股通标的权益分派、转换等处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### （6）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地A股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规

定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与A股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST及\*ST等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较A股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### （7）其他可能的风险

除上述风险外，本基金参与港股投资，还可能面临其他风险。

### 3、汇率风险

本基金以人民币募集和计价，指数成份股中包含香港市场股票。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。

此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

### 4、流动性风险

在市场或个券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、以合理成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

#### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%。通常情况下，本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障持有人利益的基础上，防范流动性风险。

#### （3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调

整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施，包括但不限于：

①暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝。

②延缓支付赎回对价

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回对价的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回对价的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

③暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十五部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被暂停接受或延缓支付赎回对价。

④中国证监会认定的其他措施。

（4）对ETF基金投资人而言，ETF可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

5、衍生品投资风险

本基金可投资于期货、期权等金融衍生品，主要存在以下风险：

- （1）市场风险：是指由于衍生品价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于衍生品合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

6、存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

#### 7、资产支持证券投资风险

本基金参与资产支持证券投资可能面临信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。本基金将通过严谨的投资研究对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。

#### 8、参与转融通证券出借业务风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在转融通业务特有风险，包括但不限于以下风险：

##### （1）流动性风险

面对大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现、支付赎回对价的风险；

##### （2）信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；

##### （3）市场风险

证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的风险；

##### （4）操作风险

由于不完善或有问题的内部操作流程、人员违规或失误、系统故障或外部事件所导致的直接或间接损失的风险。

#### 9、操作或技术风险

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

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

根据证券交易资金前端风险控制相关业务规则，中登公司和交易所对交易参与人的证券交易资金进行前端额度控制，由于执行、调整、暂停该控制，或该控制出现异常等，可能影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。

#### 10、政策变更风险



因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 11、税务风险

由于各个国家/地区在税务方面的法律法规存在一定差异，当投资某个国家/地区市场时，该国家/地区可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，各个国家/地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向该国家/地区缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### 12、法律和政治风险

由于各个国家/地区适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为在部分国家/地区受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。

基金所投资的国家/地区因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。此外，基金所投资的国家/地区可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化、没收资产以及征收高额税收等，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

#### 13、本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式的风险

本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式，即本基金参与证券交易所场内投资部分将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易，并由选定的证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易和结算模式可能增加本基金投资运作过程中的交易指令传输和资金使用效率降低的风险、估值效率降低的风险、信息系统风险、信息泄露的风险等。

#### 14、其他风险

自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

### （二）投资于本基金的特定风险

#### 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与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

## 2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而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，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

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

（2）由于标的指数成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

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

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

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

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

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

## 4、指数编制机构停止服务的风险

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转

换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。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。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作，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。

#### 5、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，基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 6、成份股停牌或违约的风险

本基金的标的指数成份股可能出现停牌或违约，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，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，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份股进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

#### 7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

#### 8、申购赎回清单差错风险

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

#### 9、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金份额参考净值（IOPV）供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考，存在IOPV不予发布的风险。由于计算公式、汇率数据来源及来源时间不同，IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异，IOPV计算还

可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### 10、退市风险

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

#### 11、投资者申购失败的风险

基金管理人有权根据本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的申购申请，从而导致申购失败。

#### 12、投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

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

#### 13、申购赎回的代理买卖风险

基金管理人可在招募说明书规定的时间内以收到的替代金额代投资者买入或卖出小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券，实际买入被替代证券的价格可能处于规定时间内较高的位置或处于最高价格，实际卖出被替代证券的价格可能处于规定时间内较低的位置或处于最低价格，基金管理人对此不承担责任。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入或不卖出部分被替代证券，或者不进行任何买入或卖出证券的操作，基金管理人可能不买入或不卖出被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足、技术系统无法实现、申购赎回轧差以及基金管理人认为不应买入或卖出的其他情形。

#### 14、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

#### 15、第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

（2）登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合

证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

（3）证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理券商及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

### （三）声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金或还通过销售机构销售，但是，本基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

3、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作出的概括性描述。销售机构根据相关法律法规对本基金进行风险评估，不同的销售机构采用的评价方法不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中的风险收益特征的表述可能存在不同，投资者应随时关注本基金风险等级的更新情况，谨慎作出投资决策。

## 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规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后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，保存期限不少于法定最低期限。

## 二十、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。



## 二十一、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、申购赎回代理机构提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

### （一）呼叫中心

#### 1、自动语音服务

提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新热点问题、基金份额净值等信息。

#### 2、人工电话服务

提供每周 7 天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为 8：30~21：00，周六至周日的人工电话服务时间为 8：30~17：00，法定节假日除外。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

### （二）在线服务

投资者可通过本公司网站、APP、微信公众号、微官网等渠道获得在线服务。

#### 1、自助服务

在线客服提供每周 7 天、每天 24 小时的自助服务，投资者可通过在线客服查询最新热点问题、业务规则、基金份额净值等信息。

#### 2、人工服务

周一至周五的在线客服人工服务时间为 8：30~21：00，周六至周日的在线客服人工服务时间为 8：30~17：00，法定节假日除外。

#### 3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

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

电子信箱：[service@ChinaAMC.com](mailto:service@ChinaAMC.com)

### （三）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过申购赎回代理

机构的服务电话对该申购赎回代理机构提供的服务进行投诉或提出建议。

### 二十三、其他应披露事项

- （一）2023年7月20日发布华夏基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告。
- （二）2023年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告。
- （三）2023年8月22日发布华夏基金管理有限公司关于华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告。
- （四）2023年9月1日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金募集期的公告。
- （五）2023年9月15日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金募集期的公告。
- （六）2023年9月26日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。
- （七）2023年9月27日发布华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告。
- （八）2023年9月28日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告。
- （九）2023年9月28日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告。
- （十）2023年9月28日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书。
- （十一）2023年10月11日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告。
- （十二）2023年10月12日发布华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理（北京）有限公司的公告。
- （十三）2023年10月18日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告。
- （十四）2023年12月20日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告。

（十五）2024年1月19日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金2023年第四季度报告。

（十六）2024年3月26日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告。

（十七）2024年3月28日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金2023年年度报告。

（十八）2024年4月19日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金2024年第一季度报告。

（十九）2024年5月10日发布华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告。

#### 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后，置备于基金管理人的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

#### 二十五、备查文件

##### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金注册的批复。
- 2、《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数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。

##### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

##### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二四年六月二十八日

## 附件一：基金合同摘要

### 第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 一、基金管理人

##### （一）基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

设立日期：1998年4月9日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38亿元人民币

存续期限：100年

联系电话：400-818-6666

##### （二）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、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》及有关法律的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与赎回申请；
  - (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券/期货所产生的权利；
  - (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、融券及转融通证券出借；
  - (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、非交易过户和转托管等的业务规则；
  - (17) 基金管理人有权根据反洗钱法律法规的相关规定，结合基金份额持有人洗钱风险状况，采取相应合理的控制措施；
  - (18) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
  - (19) 委托证券经纪商在上海证券交易所、深圳证券交易所进行各类证券交易、证券交收，以及相关证券交易的资金交收等证券经纪服务。证券经纪服务的相关权利、义务，由基金管理人与证券经纪商签订的《证券经纪服务协议》约定为准；
  - (20) 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、赎回的对价；

（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，因监管机构、司法机关等有权机关的要求以及向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

（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、足额支付赎回对价；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不少于法定最低期限；

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

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

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

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



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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，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

### （一）基金托管人简况

名称：招商银行股份有限公司

住所：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

成立时间：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复字（1986）175 号文、银复

（1987）86 号文

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83 号

### （二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因监管机构、司法机关等有权机关的要求以及向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不少于法定最低期限；

（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对价；

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

于：

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

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

- （1）**认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；**
- （2）**了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；**
- （3）**关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；**
- （4）**交纳基金认购、申购、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用，根据法律法规及证券交易所对股份减持的相关规定进行认购、申购，并及时履行因认购、申购可能产生的减持规定相关义务；**
- （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定；**
- （8）**返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；**
- （9）**遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；**
- （10）**提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时地更新和补充，并保证其真实性；**
- （11）**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。**

## 第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

### 一、召开事由

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

- （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；
- （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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）增加、减少、调整基金份额类别设置；

(4) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容；

(5) 调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；

(6) 经履行适当程序，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(7) 基金管理人、证券交易所、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、交易、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；

(8) 经履行适当程序，基金推出新业务或服务；

(9) 经履行适当程序，基金在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回等业务；

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

(11) 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；

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

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

### 四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许

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会议通知约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，法律法规和中国证监会另有规定的除外；

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月



以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 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、基金合同和中国证监会另有规定的除外）、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

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

管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规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书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## 七、计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## 八、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内按照法律法规和中国证监会相关规定的要求在规定媒介上公告。

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、关于本基金的联接基金所持本基金份额行使表决权的方式

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持

有的联接基金的基金份额行使目标 ETF 持有人大会的召集权、直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金联接基金的持有人，如经基金管理人确认其单独或合计持有的联接基金基金份额所对应的本基金份额不少于本基金总份额的 10% 的，可对本基金行使基金份额持有人大会的召集权。

如本基金召开基金份额持有人大会，本基金联接基金的基金份额持有人有权亲自出席/出具书面表决意见或以代理投票授权委托书委派代表出席/出具书面表决意见，并有权按照所持有的联接基金基金份额对应的本基金份额参与投票表决。

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

十、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 第三部分 基金收益分配原则、执行方式

#### 一、基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上，可进行收益分配；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配采用现金方式；
- 6、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无重大实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 二、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 三、收益分配方案的确定、公告与实施

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

## 第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、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、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；
- 4、《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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资费、转融通费用、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市初费及年费；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、因投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票而产生的各项合理费用；
- 12、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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—12 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、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；
- 5、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。

## 第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

### 一、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含存托凭证、科创板、创业板、港股通标的股票及中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票

据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

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

## 二、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （6）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得

展期；

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

（10）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本基金合同约定的投资范围保持一致；

（11）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（12）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（13）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（14）基金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%；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；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）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

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

（17）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；



B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

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

（19）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（6）、（9）、（10）、（17）情形之外，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、港股通额度不足等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述（17）规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）法律、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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需另行召开基金份额持有人大会。

## 第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次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，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

## 第七部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费

用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后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，保存期限不少于法定最低期限。

### 第八部分 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交北京仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则按照普通程序进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。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，各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中华人民共和国法律（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。

### 第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

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

## 附件二：基金托管协议摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：杨明辉

成立时间：1998年4月9日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

注册资本：2.38亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：100年

#### （二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：缪建民

成立时间：1987年4月8日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币252.20亿元

存续期间：持续经营

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含存托凭证、科创板、创业板、港股通标的股票及中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

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

2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- （1）基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （6）本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基

金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

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

（10）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；

（11）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（12）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（13）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（14）基金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%；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；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）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

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

（17）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

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

（19）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（6）、（9）、（10）、（17）情形之外，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、港股通额度不足等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述（17）规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需召开基金份额持有人大会审议。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

3.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；



- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、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。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需另行召开基金份额持有人大会。

4.基金参与转融通证券出借业务的，基金管理人应遵守审慎经营原则，配备专门的技术系统和管理人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制，完善业务流程，有效防范和控制风险，基金托管人将对基金参与出借业务进行监督和复核。

5.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定时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，但不得再发生新的交易。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个交易日内与基金

托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，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。

6.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人银行存款业务进行监督。

基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并通知基金管理人。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）本基金投资于有固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款，不受上述比例限制；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%；投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

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

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

1) 基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。

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

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

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

(3) 基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划付、账目核对、到期兑付、提前支取

1) 基金投资银行存款协议的签订

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

②基金托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款协议书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

③基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法等。

④由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称“存款分支机构”）寄送或上门交付存款证实书或其他有效存款凭证的，基金托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

⑤基金管理人应在《存款协议书》中规定，基金存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管账户，并在《存款协议书》写明账户名称和账号，未划入指定账户的，由存款银行承担一切责任。

⑥基金管理人应在《存款协议书》中规定，在存期内，如本基金银行账户、预留印鉴发生变更，管理人应及时书面通知存款行，书面通知应加盖基金托管人预留印鉴。存款分支机构应及时就变更事项向基金管理人、基金托管人出具正式书面确认书。变更通知的送达方式同开户手续。在存期内，存款分支机构和基金托管人的指定联系人变更，应及时加

盖公章书面通知对方。

⑦基金管理人应在《存款协议书》中规定，因定期存款产生的存单不得被质押或以任何方式被抵押，不得用于转让和背书。

## 2) 基金投资银行存款时的账户开设与管理

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

②基金投资于银行存款时的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

## 3) 存款凭证传递、账目核对及到期兑付

### ①存款证实书等存款凭证传递

存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。基金管理人应在《存款协议书》中规定，存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证（下称“存款凭证”），该存款凭证为基金存款确认或到期提款的有效凭证，且对应每笔存款仅能开具唯一存款凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款凭证复印件并与基金托管人电话确认收妥后，将存款凭证原件通过快递寄送或上门交付至基金托管人指定联系人；若存款银行分支机构代为保管存款凭证的，由存款银行分支机构指定会计主管传真一份存款凭证复印件并与基金托管人电话确认收妥。

### ②存款凭证的遗失补办

存款凭证在邮寄过程中遗失的，由基金管理人向存款银行提出补办申请，基金管理人应督促存款银行尽快补办存款凭证，并按以上①的方式快递或上门交付至托管人，原存款凭证自动作废。

### ③账目核对

每个工作日，基金管理人应与基金托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

基金管理人应在《存款协议书》中规定，对于存期超过3个月的定期存款，基金托管人于每季度向存款银行发起查询查复，存款银行应按照人行查询查复的有关时限要求及时回复。基金管理人有责任督促存款银行及时回复查询查复。因存款银行未及时回复造成的资金被挪用、盗取的责任由存款银行承担。

存款银行应配合基金托管人对存款凭证的询证，并在询证函上加盖存款银行公章寄送至基金托管人指定联系人。

#### ④到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过快递将存款凭证原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款银行未收到存款凭证原件的，应与基金托管人电话询问。存款到期前基金管理人与存款银行确认存款凭证收到并于到期日兑付存款本息事宜。

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

基金管理人应在《存款协议书》中规定，存款凭证在邮寄过程中遗失的，存款银行应立即通知基金托管人，基金托管人在原存款凭证复印件上加盖公章并出具相关证明文件后，与存款银行指定会计主管电话确认后，存款银行应在到期日将存款本息划至指定的基金资金账户。如果存款到期日为法定节假日，存款银行顺延至到期后第一个工作日支付，存款银行需按原协议约定利率和实际延期天数支付延期利息。

#### 4) 提前支取

如果在存款期限内，由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因，基金管理人可以提前支取全部或部分资金。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款银行签订的《存款协议书》执行。

#### 5) 基金投资银行存款的监督

基金托管人发现基金管理人在进行存款投资时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算，若因基金管理人拒不执行造成基金财产损失的，相关损失由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

#### 7.基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

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

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

通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司、中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

本基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

(5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流

通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

8.基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确认、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，并有权在发现后报告中国证监会。

（三）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话、邮件或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应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。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人义务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。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担，托管人在履行其通知义务后，予以免责。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金

管理人限期纠正。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、证券账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、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的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供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。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

### 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。
- 3.基金托管人按照规定开立基金财产的银行存款账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，基金管理人和基金托管人按照规定开立期货资金账户。基金管理人、基金托管人、证券经纪商应签订三方存管协议。证券经纪商根据相关法律法规、规范性文件为本



基金开立相关证券资金账户。

4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，独立核算，确保基金财产的完整和独立。

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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的资产及实物证券等在基金托管人保管期间的损坏、灭失，基金托管人不承担由此产生的责任。

6.对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任，但应予以必要的协助和配合。

7.基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金资产（包括但不限于证券交易资金账户内的资金、证券类基金资产、期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。

8.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）基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

## （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1.基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2.基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户（也可称“托管账户”），并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。托管账户名称应为“华夏中证港股通内地金融交易型开放式指数证券投资基金”，预留印鉴为基金托管人印章。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银

行存款账户进行。

3.本基金银行存款账户的开立和使用，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其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

4.基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

#### **（四）基金证券账户、证券资金账户的开立和管理**

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

证券账户开立后，基金管理人以本基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立对应的证券资金账户，并通知基金托管人。证券资金账户用于本基金证券交易的结算以及证券交易结算资金的记录，并与本基金银行存款账户之间建立唯一银证转账对应关系，证券经纪机构对开立的证券资金账户内存放的资金的安全承担责任，基金托管人不负责保管证券资金账户内存放的资金。

由基金托管人、基金管理人与证券经纪机构签订三方存管相关协议办理证券资金账户与本基金银行存款账户的银证签约手续，未经基金托管人书面同意，基金管理人不得将银证签约的指定银行结算账户（即本基金银行存款账户）变更为其他账户，否则，因此引起的法律后果及给本基金造成的损失全部由基金管理人承担。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的证券账户和证券资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

#### **（五）债券托管账户的开立和管理**

1.基金合同生效后，基金管理人负责向中国人民银行进行报备，基金托管人在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2.基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

#### （六）期货相关账户的开立和管理

基金管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等，基金托管人按照规定开立期货结算账户等投资所需账户。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和市场监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和市场监控中心登录密码重置由基金管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

基金托管人和基金管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。基金管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给基金托管人。

#### （七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律、法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （八）基金财产投资的有关实物证券等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入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、中国证券登记结算有限责任公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。基金管理人向基金托管人提供的合同传真件与基金管理人留存原件不一致的，以传真件为准。

### 五、基金资产净值计算与复核

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1.基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是指估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值（如有）发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限不少于法定最低期限。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。

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交北京仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则按照普通程序进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局的，并对双方当事人均有约束力。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，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律（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）管辖。

## 八、基金托管协议的修改与终止

### （一）基金托管协议的变更

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。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议的终止

- 1.《基金合同》终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### 附件三：标的指数编制方案

（最新的指数编制方案可登录指数公司网站查询）

中证港股通内地金融指数从港股通范围内选取内地控股金融主题上市公司证券作为指数样本，以反映港股通范围内内地金融上市公司证券的整体表现。

#### 一、指数名称和代码

指数名称：中证港股通内地金融指数

指数简称：港股通内地金融

英文名称：CSI Hong Kong Connect Mainland Financials Index

英文简称：HKC Mainland Financials

指数代码：H11146（港元）/H11151（人民币）

#### 二、指数基日和基点

该指数以 2007 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

#### 三、样本选取方法

##### 1、样本空间

中证港股通中国内地企业综合指数样本

##### 2、可投资性筛选

对样本空间内证券，计算每月的日换手率中位数作为月换手率，剔除过去 12 个月或过去 3 个月平均月换手率不足 0.1% 的证券，除非该证券过去一年日均成交金额大于 5000 万港元。

##### 3、选样方法

（1）对样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取银行、保险、资本市场及其它金融行业的上市公司证券作为待选样本；

（2）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本，若待选样本数量不足 50 只时全部纳入。

#### 四、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 =  $\sum$ (证券价格 × 调整股本数 × 权重因子 × 汇率)。汇率、调整股本数的计

算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%，且前五大样本合计权重不超过 60%。

## 五、指数样本和权重调整

### 1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

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。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当港股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应调整。