

# 南方国证交通运输行业交易型开放式指数 证券投资基金招募说明书（更新）

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

截止日：2024年09月20日

## 重要提示

本基金经中国证监会 2022 年 9 月 9 日证监许可〔2022〕2075 号文注册募集。本基金的基金合同已于 2022 年 11 月 23 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，流动性风险。本基金是跟踪标的指数的交易型开放式基金，本基金标的指数为国证交通运输行业指数，及其未来可能发生的变更。投资本基金可能遇到的风险还包括：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及跟踪误差未达约定目标的风险、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、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险、第三方机构服务的风险（包括指数编制机构停止服务风险）、成份股停牌/摘牌的风险、操作或技术风险、基金合同提前终止的风险、投资于存托凭证的风险、风险评价不一致的风险、其他风险等等。本基金被动跟踪标的指数“国证交通运输行业指数”及其未来可能发生的变更，因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。同时，本基金属股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金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，可能存在流动性风险、市场风险和信用风险等转融通业务特有风险。

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、摘牌等潜在风险。

《基金合同》生效后，连续 50 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。投资者可能面临基金合同提前终止的风险。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与中国存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所，本基金的申购、赎回包括场外实物申购赎回方式和场内申购赎回方式 2 种方式。

场外实物申购赎回方式，采用组合证券“场外实物申购、赎回”的模式办理，其申购、赎回流程与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的单市场 ETF 产品有所差异。通常情况下，投资者的申购、赎回申请在 T+1 日确认，申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有，同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。

场内申购赎回方式，采用“场内部分实物、部分现金”的模式办理，投资者的申购、赎回申请在受理当日确认。投资人当日竞价买入的 ETF 份额，当日可以赎回；当日大宗买入的 ETF 份额，次一交易日可以赎回；当日申购的 ETF 份额，当日可以竞价卖出，次一交易日可以赎回或者大宗卖出；当日赎回 ETF 份额得到的股票，当日可以竞价卖出，次一交易日可以用于申购 ETF 份额或者大宗卖出；当日竞价买入的股票，当日可以用于申购 ETF 份额；当日大宗买入的股票，次一交易日可以用于申购 ETF 份额。投资人投资本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户或基金账户。其中，深圳证券交易所基金账户只能进行基金的二级市场交易，如投资人需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资人保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金标的指数为国证交通运输行业指数。

国证交通运输行业指数根据国证行业分类标准，选取沪深两市 A 股二级行业为运输的公司构成指数样本股。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司网站，网址：[www.cnindex.com.cn](http://www.cnindex.com.cn)。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2024 年 9 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 6 月 30 日（未经审计）。

## 目录

§1 绪言.....	5
§2 释义.....	6
§3 基金管理人.....	11
§4 基金托管人.....	21
§5 相关服务机构.....	23
§6 基金的募集.....	41
§7 基金合同的生效.....	42
§8 基金份额折算与变更登记.....	43
§9 基金份额的上市与交易.....	44
§10 基金份额的申购赎回.....	46
§11 基金的投资.....	65
§12 基金的财产.....	80
§13 基金资产估值.....	81
§14 基金的收益与分配.....	86
§15 基金的费用与税收.....	88
§16 基金的会计与审计.....	90
§17 基金的信息披露.....	91
§18 风险揭示.....	97
§19 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	104
§20 基金合同的内容摘要.....	106
§21 基金托管协议的内容摘要.....	125
§22 基金份额持有人服务.....	139
§23 其他应披露事项.....	141
§24 招募说明书存放及其查阅方式.....	143
§25 备查文件.....	144

## § 1 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国民法典》、《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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规，以及《南方国证交通运输行业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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

## § 2 释义

《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指南方基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《南方国证交通运输行业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《南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《南方国证交通运输行业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《南方国证交通运输行业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《南方国证交通运输行业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《南方国证交通运输行业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、《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过，经 2004 年 8 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十一次会议《关于修改〈中华人民共和国证券法〉的决定》第一次修正，经 2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议第一次修订，经 2013 年 6 月 29 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第三次会议《关于修改〈中华人民共和国文物保护法〉等十二部法律的决定》第二次修正，经 2014 年 8 月 31 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十次会议《关于修改〈中华人民共和国保险法〉等五部法律的决定》第三次修正，并经 2019 年 12 月 28 日第十三届全国人民代表大会常务委员会第十五次会议第二次修订的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

16、《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

17、《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

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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、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

26、交易型开放式证券投资基金：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（以下简称“《登记结算业务实施细则》”）定义的“交易型开放式证券投资基金”，简称 ETF

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

28、**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、赎回等业务

29、**销售机构**：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括直销机构、发售代理机构、申购赎回代理券商

30、**基金销售网点**：指基金销售机构的销售网点

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、**申购赎回代理券商**：指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

33、**登记业务**：指根据《登记结算业务实施细则》及其不时修订以及相关业务规则所定义的基金份额的登记、存管和结算等相关业务

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、深圳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

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》**：指中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）、深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》（包括其不时修订）及中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所发布的其他相关规则 and 规定，以及南方基金管理股份有限公司发布的《南方基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》及其他相关规则 and 规定

45、**认购**：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书和相关公告的规定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、招募说明书和相关公告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、招募说明书和相关公告规定的条件，要求将基金份额转换为基金合同和招募说明书约定的赎回对价的行为

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：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

50、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

51、标的指数：本基金标的指数为国证交通运输行业指数，及其未来可能发生的变更

52、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

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

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

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

56、元：指人民币元

57、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

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

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、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

61、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

62、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

63、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

64、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，但法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

65、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。

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## § 3 基金管理人

### 3.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：周易

注册资本：3.6172 亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：鲍文革

1998 年，南方基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本增至 1.5 亿元人民币。2014 年公司进行增资扩股，注册资本金增至 3 亿元人民币。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。

2019 年 7 月 30 日，公司注册资本增至 3.6172 亿元。2021 年 10 月 19 日，公司股权结构调整为华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。

### 3.2 主要人员情况

#### 3.2.1 董事会成员

周易先生，计算机通信专业学士，中国籍。曾任职江苏省邮电学校、江苏省邮电管理局电信中心、江苏移动通信有限公司，曾任江苏贝尔通信系统有限公司董事长，南京欣网视讯科技股份有限公司董事长，上海富欣通信公司副总经理，华泰证券党委副书记、总裁、党委书记、董事长、党委委员。现任华泰证券股份有限公司首席执行官、执行委员会主任、董事，

南方基金管理股份有限公司董事长，南方东英资产管理有限公司董事长，华泰金融控股（香港）有限公司董事，Huatai Securities (Singapore) Pte. Limited 董事。

张辉先生，管理学博士，中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司，曾任华泰证券资产管理总部高级经理、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理、人力资源部总经理、党委组织部部长。现任华泰证券股份有限公司执行委员会委员、董事会秘书、党委委员，南方基金管理股份有限公司董事。

陈莉女士，法学硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任华泰证券深圳民田路营业部总经理、深圳益田路营业部总经理、研究所副所长、研究所所长、执行委员会主任助理等职务。现任南方基金管理股份有限公司董事、党委书记。

杜秀峰先生，经济学和经济法学研究生毕业，中国籍。曾任广东省深圳市监察局政策法规处副主任科员、办公室主任科员，深圳市国资委监督稽查处副处长，深圳市国有资产监督管理局监督稽查处副处长、办公室（信访室）副主任、企业领导人员管理处副处长，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会企业领导人员管理处副处长、处长，深圳市投资控股有限公司党委委员、副总经理。现任深圳市投资控股有限公司党委副书记、董事，兼任深圳市高新投集团有限公司董事，中国南山开发（集团）股份有限公司副董事长，深圳清华大学研究院理事、秘书长，深圳市赤湾产业发展有限公司副董事长，南方基金管理股份有限公司董事。

李平先生，工商管理硕士，中国籍。曾任深圳市城市建设开发（集团）有限公司办公室、董办主管，深圳市投资控股有限公司办公室高级主管、企业三部高级主管、金融发展部副部长。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部部长，兼任深圳市高新投集团有限公司董事，深圳市高新投融资担保有限公司董事，深圳市城市建设开发（集团）有限公司董事，深圳资产管理有限公司董事，深圳市投控资本有限公司董事，深圳市投控东海投资有限公司董事，招商局仁和人寿保险股份有限公司监事，金融稳定发展研究院理事，深圳市鹏联投资有限公司执行董事、总经理，深圳市投控联投有限公司执行董事、总经理，南方基金管理股份有限公司董事。

陈明雅女士，管理学学士，注册会计师，中国籍。曾任厦门国际信托有限公司财务部副总经理、财务部总经理、投资发展部总经理，现任厦门国际信托有限公司财务总监、财务部总经理，南方基金管理股份有限公司董事。

王斌先生，医学博士，中国籍。曾任安徽泗县人民医院临床医生，瑞金医院感染科临床医生，兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理（主持工作）、总经理。现任兴业证券总裁助理、经济与金融研究院院长、兴证智库主任，南方基金管理股份有限公司董事。

杨小松先生，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职德勤国际会计师行、光大银行证券部、中国证监会等机构，曾任南方基金督察长。现任南方基金管理股份有限公司董事、总经理、首席信息官，南方东英资产管理有限公司董事。

李心丹先生，金融学博士，国务院特殊津贴专家，教育部长江学者特聘教授，中国籍。曾任东南大学经济管理学院教授，南京大学工程管理学院院长。现任南京大学新金融研究院院长、金融工程研究中心主任，南京大学教授、博士生导师，中国金融学年会常务理事、秘书长，江苏省资本市场研究会荣誉会长，江苏省科技创新协会副会长，江苏银行独立董事，汇丰银行（中国）独立董事，东吴证券股份有限公司独立董事，上海证券交易所科创板制度评估专家委员会主任，南方基金管理股份有限公司独立董事。

张忠先生，法学硕士，中国籍。曾任北京市人民政府公务员。现任北京市中伦律师事务所一级合伙人、资本市场业务负责人、证券业务内核负责人，银联商务股份有限公司独立董事，中国东方红卫星股份有限公司独立董事，中国重汽（香港）有限公司独立非执行董事，协和新能源（香港）有限公司独立非执行董事，南方基金管理股份有限公司独立董事。

林斌先生，会计学博士，澳大利亚资深注册会计师，中国籍。曾任中山大学管理学院会计学系主任，MPAcc 教育中心主任，广东省审计学会副会长，广东省资产评估协会副会长，广东省内部审计协会副会长。现任广东省总工会经审会常委，广东管理会计师协会会长，广东省内部控制协会副会长，长城证券股份有限公司独立董事，中船海洋与防务装备股份有限公司独立董事，南方基金管理股份有限公司独立董事。

郑建彪先生，经济学硕士，高级工商管理硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任北京市财政局干部，深圳蛇口中华会计师事务所经理，京都会计师事务所副主任，北京注册会计师协会副会长。现任致同会计师事务所（特殊普通合伙）管理合伙人，全联（中国）并购公会常务会长，中国上市公司协会财务总监委员会副主任、并购融资委员会委员，南方基金管理股份有限公司独立董事。

徐浩萍女士，会计学博士，中国籍。曾任职江苏省丝绸进出口股份有限公司、南京环球杰必克有限责任公司、南京国电南自股份有限公司，复旦大学教师。现任复旦大学管理学院副教授，无锡林泰克斯新材料科技股份有限公司独立董事，苏州海光芯创光电科技股份有限公司独立董事，苏州汇科技术股份有限公司独立董事，南方基金管理股份有限公司独立董事。

### 3.2.2 监事会成员

孙明辉先生，经济学硕士，高级会计师，中国籍。曾任职深圳能源财务有限公司、深圳能源集团股份有限公司财务管理部，深圳市投资控股有限公司财务部高级主管、董事会办公室高级主管、财务部（结算中心）副部长、部长。现任深圳市投资控股有限公司总会计师，南方基金管理股份有限公司监事会主席。

费扬文先生，经济学博士，中国籍。曾任交通银行管理培训生、投资银行部债务融资部高级项目经理，华泰证券股份有限公司固定收益部副总经理、资金运营部副总经理、资金运营部总经理、浙江分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司执行委员会主任助理、深圳分公司总经理，南方基金管理股份有限公司监事。

蔡云霖先生，企业管理专业学士，中级会计师，中国籍。曾任职天同证券厦门中心营业部、厦门市商业银行，曾任中国民生银行厦门分行投资银行部投资银行中心副经理、金融市场部理财及资产管理中心总经理、机构金融一部总经理助理，厦门市融资担保有限公司投资发展部总经理。现任厦门国际信托有限公司党委委员、总经理助理、投资研究部总经理，南方基金管理股份有限公司监事。

郑可栋先生，经济学硕士，中国籍。曾任国泰君安证券网络金融部高级策划经理，兴业证券战略发展部经营计划与绩效分析经理、私财委科技金融部规划发展负责人、经纪业务总部投顾平台运营处总监和理财规划处总监、财富管理部总经理助理、数智金融部副总经理。现任兴业证券财富管理部副总经理，南方基金管理股份有限公司监事。

陆文清先生，工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍，无境外永久居留权。曾任职东联融资租赁有限公司，曾任南方基金合肥理财中心职员、客户关系部高级副总裁、合肥理财中心总经理。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、客户关系部总经理兼合肥分公司总经理。

徐刚先生，工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任深圳中期期货经纪公司交易部员工、项目经理，南方基金上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司副总经理、董事等职务。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、养老金业务部执行董事。

高嘉骏先生，金融学学士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国人寿保险湖南省分公司、东风日产汽车金融有限公司、万家基金管理有限公司，南方基金广州营销中心职员。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、深圳分公司董事。

王益平女士，金融学硕士，特许公认会计师，金融风险管理师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职沃尔玛中国有限公司、安永华明会计师事务所，南方基金运作保障部职员。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、运作保障部董事。

### 3.2.3 公司高级管理人员

杨小松先生，总经理、首席信息官，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍，无境外永久居留权。曾在德勤国际会计师事务所、光大银行证券部、中国证监会等机构任职，曾任南方基金督察长。现任南方基金管理股份有限公司董事、总经理、首席信息官，南方东英资产管理有限公司董事。

俞文宏先生，副总经理、董事会秘书，工商管理硕士，经济师，中国籍，无境外永久居留权。曾在江苏国信集团任职，曾任南方资本管理有限公司董事长、总经理，深圳南方股权投资基金管理有限公司董事长等职务。现任南方基金管理股份有限公司副总经理、董事会秘书。

李海鹏先生，副总经理，工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍，无境外永久居留权。曾任美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，南方基金高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总裁助理兼固定收益投资总监，南方东英资产管理有限公司董事等职务。现任南方基金管理股份有限公司副总经理、首席投资官（固定收益）。

鲍文革先生，督察长，经济学硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任财政部中华会计师事务所审计师，南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理，南方基金运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理等职务。现任南方基金管理股份有限公司督察长，南方资本管理有限公司董事。

蔡忠评先生，财务负责人，经济学硕士，中国注册会计师、特许公认会计师公会资深会员（FCCA），中国籍，无境外永久居留权。曾任中南财经大学助教，招商局蛇口工业区总会计师室会计，国信证券有限责任公司资金财务部高级经理，普华永道会计师事务所高级审计师，国投瑞银基金管理有限公司财务部总监等职务。现任南方基金管理股份有限公司财务负责人兼财务部总经理，南方东英资产管理有限公司董事，南方资本管理有限公司监事，深圳南方股权投资基金管理有限公司董事。

孙鲁闽先生，副总经理，会计商学、基金管理商学硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任厦门国际银行福州分行电脑部主管，南方基金研究员、投资经理、基金经理、投资部副总监等职务。现任南方基金管理股份有限公司副总经理、联席首席投资官、基金经理兼任私募资管计划投资经理。

侯利鹏先生，副总经理，工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任沈阳财政证券公司交易部经理、客户服务部经理，中融基金管理有限公司副总经理，南方基金北京分公司总经理、零售服务部总经理、公司总经理助理、首席市场官等职务。现任南方基金管理股份有限公司副总经理。

茅炜先生，副总经理，经济学学士，中国籍，无境外永久居留权。曾任东方人寿保险股份有限公司保险精算员，生命人寿保险股份有限公司保险精算员，国金证券股份有限公司研究员，南方基金研究员、投资经理、基金经理、研究部负责人、权益研究部总经理、权益投资部总经理等职务。现任南方基金管理股份有限公司副总经理、首席投资官（权益）、权益研究部总经理、基金经理。

### 3.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为：崔蕾女士，管理时间为 2022 年 11 月 23 日至今。

崔蕾女士，康奈尔大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。

### 3.2.5 投资决策委员会成员

副总经理兼首席投资官（固定收益）李海鹏先生，副总经理、首席投资官（权益）兼权益研究部总经理茅炜先生，副总经理兼联席首席投资官孙鲁闽先生，现金及债券指数投资部总经理夏晨曦先生，交易管理部总经理王珂女士，固定收益投资部总经理李璇女士，混合资产投资部总经理乔羽夫先生，固定收益研究部总经理陶铄先生，权益投资部总经理张延闽先生，指数投资部总经理罗文杰女士，宏观策略部联席总经理兼量化投资部总经理唐小东先生。

### 3.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 3.3 基金管理人的职责

- （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；
- （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) 计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价；
- (8) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (9) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (10) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (11) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (12) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

### 3.4 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他相关法律法规行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事下列行为：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3.5 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他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的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### 3.6 基金经理承诺

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

### 3.7 基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

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

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

#### 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 3、主要内部控制制度

#### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

#### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

#### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflow。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## § 4 基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张金良

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：王小飞

联系电话：(021)6063 7103

### （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金业务处、证券保险业务处、理财信托业务处、全球业务处、养老金业务处、新兴业务处、客户服务与业务协同处、运营管理处、跨境与外包管理处、托管应用系统支持处、内控合规处等 12 个职能处室，在北京、上海、合肥设有托管运营中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2023 年年末，中国建设银行已托管 1334 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并先后荣获《亚洲银行家》颁发的 2017 年度“最佳托管系统实施奖”、2019 年度“中国年度托管业务科技实施奖”、2021 年度“中国最佳数字化资产托管银行”、以及 2020 及 2022 年度“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。2022 年度，荣获《环球

金融》“中国最佳次托管银行”，并作为唯一中资银行获得《财资》“中国最佳 QFI 托管银行”奖项。2023 年度，荣获中国基金报“公募基金 25 年最佳基金托管银行”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制的有效性进行指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，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开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## § 5 相关服务机构

### 5.1 销售机构

#### 5.1.1 申购赎回代理证券公司

交运 ETF 申购赎回代理证券公司：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路 228 号 法定代表人：张伟 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
2	兴业证券股份有限公司	注册地址：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 联系人：乔琳雪 联系电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：www.xyzq.com.cn
3	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红 岭中路 1012 号国信证券大 厦十六层至二十六层 办公地址：深圳市福田区福 华一路 125 号国信金融大厦

		<p>法定代表人：张纳沙</p> <p>联系人：于智勇</p> <p>电话：0755-82130833</p> <p>客服电话：95536</p> <p>网址：www.guosen.com.cn</p>
4	中国银河证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101</p> <p>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</p> <p>法定代表人：王晟</p> <p>联系人：辛国政</p> <p>联系电话：010-80928123</p> <p>客服电话：4008-888-888、95551</p> <p>网 址：www.chinastock.com.cn</p>
5	国泰君安证券股份有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号</p> <p>办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦</p> <p>法定代表人：朱健</p> <p>联系人：芮敏祺</p> <p>电话：021-38676666</p> <p>客服电话：4008888666</p> <p>网址：www.gtja.com</p>
6	中泰证券股份有限公司	<p>注册地址：济南市市中区经七路86号</p>



		<p>办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号</p> <p>法定代表人：王洪</p> <p>联系人：张峰源</p> <p>电话：021-20315719</p> <p>客服电话：95538</p> <p>网址：www.zts.com.cn</p>
7	海通证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市广东路 689 号</p> <p>办公地址：上海市中山南路 888 号</p> <p>法定代表人：周杰</p> <p>传真：021-63809892</p> <p>联系人：徐步夷</p> <p>客服电话：95553</p> <p>网址：www.htsec.com</p>
8	中信建投证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼</p> <p>办公地址：北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 13 层</p> <p>法定代表人：王常青</p> <p>联系人：谢欣然</p> <p>联系电话：010-56135799</p> <p>客服电话：4008888108</p> <p>网址：www.csc108.com</p>
9	广发证券股份有限公司	<p>注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室</p>

		<p>办公地址：广州市天河区马 场路 26 号广发证券大厦</p> <p>法定代表人：林传辉</p> <p>联系人：黄岚</p> <p>客服电话：95575、020-95575 或致电各地营业网点</p> <p>网址：<a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
10	长城证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福 田街道金田路 2026 号能源 大厦南塔楼 10-19 层</p> <p>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</p> <p>法定代表人：王军</p> <p>联系人：杨茜淳</p> <p>联系电话：0755-83558761</p> <p>客服电话：0755-33680000 4006666888</p> <p>网址：<a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a></p>
11	招商证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福 田街道福华一路 111 号</p> <p>办公地址：深圳市福田区福 华一路 111 号招商证券大厦 24 楼</p> <p>法定代表人：霍达</p> <p>联系人：业清扬</p> <p>客服电话：95565/0755-95565</p> <p>网址：<a href="http://www.cmschina.com">www.cmschina.com</a></p>

12	中信证券股份有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦</p> <p>法定代表人：张佑君</p> <p>联系人：王一通</p> <p>电话：010-60838888</p> <p>传真：010-60833739</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：www.cs.ecitic.com</p>
13	申万宏源证券有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层</p> <p>办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层</p> <p>法定代表人：张剑</p> <p>联系人：鲍佳琪</p> <p>电话：021-33388378</p> <p>传真：021-33388224</p> <p>客服电话：95523、4008895523</p> <p>网址：www.swhysc.com</p>
14	光大证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市静安区新闻路1508号</p> <p>办公地址：上海市静安区新闻路1508号</p> <p>法定代表人：刘秋明</p> <p>联系人：郁疆</p>

		<p>联系电话:021-22169999</p> <p>客服电话: 95525</p> <p>网址: <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a></p>
15	中国中金财富证券有限公司	<p>注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 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</p> <p>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</p> <p>法定代表人:高涛</p> <p>联系人: 万玉琳</p> <p>联系电话: 0755-82026907</p> <p>传真 0755-82026539</p> <p>客服电话: 400-600-8008、95532</p> <p>网址: <a href="http://www.ciccwm.com">www.ciccwm.com</a></p>
16	申万宏源西部证券有限公司	<p>注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室</p> <p>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</p> <p>法定代表人: 王献军</p> <p>联系人: 梁丽</p>

		<p>联系电话：0991-2307105</p> <p>传真：010-88085195</p> <p>客服电话：95523、4008895523</p> <p>网址：www.swhysc.com</p>
17	湘财证券股份有限公司	<p>注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼</p> <p>办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼</p> <p>法定代表人：高振营</p> <p>联系人：江恩前</p> <p>联系电话：021-50295432</p> <p>客服电话：95351</p> <p>网址：www.xcsc.com</p>
18	国投证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦</p> <p>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</p> <p>法定代表人：段文务</p> <p>联系人：陈剑虹</p> <p>联系电话：0755-81688000</p> <p>客服电话：95517</p> <p>网 址： <a href="http://www.essence.com.cn/">http://www.essence.com.cn/</a></p>

19	中信证券（山东）有限责任公司	<p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001</p> <p>办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座</p> <p>法定代表人：肖海峰</p> <p>联系人：赵如意</p> <p>联系电话：0532-85725062</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：sd.citics.com</p>
20	东方证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层</p> <p>办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层</p> <p>法定代表人：金文忠</p> <p>联系人：胡月茹</p> <p>联系电话：021-63325888</p> <p>客服电话：95503</p> <p>网址：www.dfzq.com.cn</p>
21	上海证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼</p> <p>办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼</p> <p>法定代表人：李海超</p> <p>联系人：邵珍珍</p> <p>联系电话：021-53686888</p>

		传真：021-53686100-7008 客服电话：4008918918 网址：www.shzq.com
22	平安证券股份有限公司	注册地址：深圳市福田区中心 区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 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 联系人：王阳 联系电话：021-38637436 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
23	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星 阳街 5 号 办公地址：苏州工业园区星 阳街 5 号 法定代表人：范力 联系人：陆晓 电话：0512-62938521 传真：0512-65588021 客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn
24	中信证券华南股份有限公司	注册地址：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）

		<p>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）</p> <p>法定代表人：陈可可</p> <p>联系人：何雯</p> <p>联系电话：020-88836999</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：www.gzs.com.cn</p>
25	华宝证券股份有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层</p> <p>法定代表人：刘加海</p> <p>联系人：闪雨晴</p> <p>电话：021-20515465</p> <p>传真：021-68408217-7517</p> <p>客服电话：4008209898</p> <p>网址：www.cnhbstock.com</p>
26	华福证券有限责任公司	<p>注册地址：福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 座</p> <p>法定代表人：苏军良</p> <p>联系人：王虹</p> <p>电话：021-20655183</p>



		<p>传真：021-20655196</p> <p>客服电话：95547</p> <p>网址：www.hfzq.com.cn</p>
27	中原证券股份有限公司	<p>注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号</p> <p>办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号</p> <p>法定代表人：鲁智礼</p> <p>联系人：程月艳 李盼盼</p> <p>电话 0371-69099881、0371-69099882</p> <p>传真：0371-65585899</p> <p>客服电话：95377</p> <p>网址：www.ccnew.com</p>
28	西南证券股份有限公司	<p>注册地址：重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼</p> <p>法定代表人：吴坚</p> <p>联系人：杜巧</p> <p>联系电话：023-67500573</p> <p>客服电话：95355</p> <p>网址：www.swsc.com.cn</p>
29	财达证券股份有限公司	<p>注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号</p> <p>办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦</p> <p>法定代表人：张明</p> <p>联系人：李鹏</p>

		<p>联系电话：0311-86273126</p> <p>客服电话：95363</p> <p>网址：www.95363.com</p>
30	德邦证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼</p> <p>办公地址：上海市黄浦区中山东二路600号上海BFC外滩金融中心N1栋7层</p> <p>法定代表人：武晓春</p> <p>联系人：王芙佳</p> <p>电话：021-68761616</p> <p>传真：021-68767032</p> <p>客服电话：4008888128</p> <p>网址：www.tebon.com.cn</p>
31	国盛证券有限责任公司	<p>注册地址：江西省南昌市新建区子实路1589号</p> <p>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</p> <p>法定代表人：徐丽峰</p> <p>联系人：占文驰</p> <p>联系电话：0791-88250812</p> <p>客服电话：956080</p> <p>网址：www.gsyzq.com</p>
32	方正证券股份有限公司	<p>注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717</p>

		<p>办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层</p> <p>法定代表人：施华</p> <p>联系人：胡创</p> <p>联系电话：010-59355997</p> <p>客服电话：95571</p> <p>网址：www.foundersec.com</p>
33	财通证券股份有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼</p> <p>办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼</p> <p>法定代表人：章启诚</p> <p>联系人：蔡驰宙</p> <p>联系电话：0571-87821867</p> <p>客服电话：95336,40086-96336</p> <p>网址：www.ctsec.com</p>
34	东海证券股份有限公司	<p>注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼</p> <p>办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦</p> <p>法定代表人：王文卓</p> <p>电话：021-20333333</p> <p>传真：021-50498825</p>

		<p>客服电话: 95531; 400-8888-588</p> <p>网址: <a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a></p>
35	金元证券股份有限公司	<p>注册地址: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼</p> <p>办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层</p> <p>法定代表人: 陆涛</p> <p>联系人: 刘萍</p> <p>联系电话: 0755-83025693</p> <p>客服电话: 95372</p> <p>网址: <a href="http://www.jyzq.cn">www.jyzq.cn</a></p>
36	万联证券股份有限公司	<p>注册地址: 广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层</p> <p>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</p> <p>法定代表人: 王达</p> <p>联系人: 丁思</p> <p>联系电话: 020-83988334</p> <p>客服电话: 95322</p> <p>网址: <a href="http://www.wlzq.cn">www.wlzq.cn</a></p>
37	国金证券股份有限公司	<p>注册地址: 成都市东城根上街 95 号</p> <p>办公地址: 成都市东城根上街 95 号</p> <p>法定代表人: 冉云</p> <p>联系人: 刘一君</p> <p>联系电话: 18500852451</p>

		传真：028-86690126 客服电话：95310 网址：www.gjq.com.cn
38	华鑫证券有限责任公司	注册地址：深圳市福田区香 蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 办公地址：上海市黄浦区福 州路 666 号 法定代表人：俞洋 联系人：刘熠 电话：021-54967387 传真：021-54967280 客 服 电 话 ： 95323 ， 4001099918 网址：http://www.cfsc.com.cn
39	东兴证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金 融大街 5 号（新盛大厦）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、16 层 北京市西城区金融大街 9 号 金融街中心 17、18 层 北京市西城区金融大街乙 9 号金融街中心 17、18 层 法定代表人：李娟 联系人：程浩亮 电话：010- 66559211

		<p>传真：010-66555133</p> <p>客服电话：95309</p> <p>网址：www.dxzq.net</p>
40	万和证券股份有限公司	<p>注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼</p> <p>办公地址：深圳市福田区深南大道 7028 号 时代科技大厦 20 层西厅</p> <p>法定代表人：甘卫斌</p> <p>联系人：张雷</p> <p>电话：0755-82830333</p> <p>传真：0755-25170093</p> <p>客服电话：4008-882-882</p> <p>网址：http://www.vanho.cn/</p>
41	联储证券股份有限公司	<p>注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层</p> <p>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 25 层</p> <p>法定代表人：吕春卫</p> <p>联系人：王龙</p> <p>电话：010-86499479</p> <p>传真：010-86499401</p> <p>客服电话：956006</p> <p>网址：www.lczq.com</p>
42	东方财富证券股份有限公司	<p>注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼</p>

		办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦 法定代表人：戴彦 联系人：陈亚男 客服电话：95357 网址： <a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a>
43	本基金其他代销机构情况详见基金管理人网站列示	

### 5.1.2 二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司

### 5.2 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
 注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
 法定代表人：于文强  
 电话：4008058058  
 联系人：苑泽田

### 5.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所  
 注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
 负责人：韩炯  
 联系人：丁媛  
 电话：(86 21) 3135 8666  
 传真：(86 21) 3135 8600  
 经办律师：黎明、丁媛

### 5.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
 住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：吴玲玮

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：张振波、吴玲玮



## § 6 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2022 年 9 月 9 日证监许可〔2022〕2075 号文注册募集。

本基金为交易型开放式基金，股票型基金，基金存续期限为不定期。募集期自 2022 年 11 月 14 日至 2022 年 11 月 18 日止，共募集 717,613,946.00 份基金份额，募集户数为 7012 户。

## § 7 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同的生效

本基金合同于 2022 年 11 月 23 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开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。

## § 8 基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。

### 一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

### 二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化（上述折算可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值）。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

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

### 三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

## § 9 基金份额的上市与交易

### 一、基金份额的上市

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

- 1、基金场内募集金额（含网下股票所认购募集的股票市值）不低于 2 亿元；
- 2、基金场内份额持有人不少于 1000 人；
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

### 二、基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易，应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

### 三、停复牌、暂停上市、恢复上市及终止上市交易

基金份额在深圳证券交易所上市后，如遇停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市的情形，按照深圳证券交易所的相关规定执行。当基金发生深圳证券交易所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金变更为跟踪标的指数的普通开放式基金或上市开放式基金（LOF），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、相应调整申购赎回业务规则、提前制定基金终止上市后场内份额的处理规则并公告，同时，基金管理人可按照《信息披露办法》的规定，公告变更后的基金合同及招募说明书。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

### 四、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，基金管理人或基金管理人委托的其他机构可以在相关证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向深圳证券交易所发送，由深圳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。

#### 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 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用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差额） / 最小申购赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。若深圳证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、深圳证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值的计算方法，并予以公告。

五、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在其他证券交易所（含境外证券交易所）上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

六、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，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。

七、若深圳证券交易所、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。

## § 10 基金份额的申购赎回

本基金的基金份额申购与赎回包括场外实物申购赎回方式和场内申购赎回方式 2 种方式。场外实物申购赎回方式下，深圳证券交易所上市的成份股和上海证券交易所上市的成份股均采用组合证券申购赎回。场内申购赎回方式下，深圳证券交易所上市的成份股采用组合证券申购赎回；上海证券交易所上市的成份股必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。具体开通情况详见相关业务公告。

### 10.1 申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

具体的申购赎回代理券商将由基金管理人在基金管理人网站或相关文件列示，基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

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

### 10.2 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

### 10.3 申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。
- 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》的规定。
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，或依据深圳证券交易所或登记机构相关规则及其变更调整上述原则，但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。

#### 10.4 申购和赎回的程序

本基金的基金份额申购与赎回包括场外实物申购赎回方式和场内申购赎回方式 2 种方式。场外实物申购赎回方式下，深圳证券交易所上市的成份股和上海证券交易所上市的成份股均采用组合证券申购赎回。场内申购赎回方式下，深圳证券交易所上市的成份股采用组合证券申购赎回；上海证券交易所上市的成份股必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。具体开通情况详见相关业务公告。

##### （一）场外实物申购赎回方式

###### 1、申购和赎回的申请方式

（1）投资者办理申购或赎回业务，应同时持有并使用深圳 A 股账户和上海 A 股账户，并保证这两个账户的证件号码和名称属于同一投资者所有；

（2）投资者的相关证券和基金份额应当托管在申购赎回代理券商，且投资者深圳托管的托管单元与上海指定交易的交易单元为同一申购赎回代理券商；

（3）投资者通过该申购赎回代理券商申报申购、赎回业务。

投资人须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资人申购本基金时，须根据申购赎回清单备足申购对价；投资人提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。否则所提交的申购、赎回申请无效。

###### 2、申购和赎回的确认

基金投资者申购、赎回申请在 T+1 日进行确认。

对于投资者提交的申购申请，申购赎回代理券商根据投资者提交的申购申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资者账户内的组合证券、现金替代款和预估现金差额。T+1 日，基金管理人对冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，则申购申请失败。

对于投资者提交的赎回申请，申购赎回代理券商根据投资者提交的赎回申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资者账户内的基金份额、预估现金差额。T+1 日，基金管理人根据冻结情况对投资者的赎回申请予以确认。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。

投资者可在 T+2 日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。

### 3、申购与赎回的清算交收与登记

本基金申购和赎回过程中涉及的申购赎回对价和基金份额的交收适用《业务规则》的规定。

T+1 日，登记机构根据基金管理人对于申购、赎回申请的确认信息，为投资者办理组合证券、基金份额的清算交收，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资者 T 日申购所得的基金份额、赎回所得的组合证券在 T+2 日可用。现金替代和现金差额由基金管理人与申购赎回代理券商于 T+1 日进行清算，T+2 日进行交收，登记机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请，登记机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻，申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。

如果登记机构在清算交收时发生清算交收参与方不能正常履约的情形，则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

投资者应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资者原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

若投资者用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记机构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。

4、如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行。基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## （二）场内申购赎回方式

### 1、申购和赎回的申请方式

- （1）投资者办理申购或赎回业务，应持有并使用深圳 A 股账户；



(2) 投资者的相关证券和基金份额应当托管在申购赎回代理券商；

(3) 投资者通过该申购赎回代理券商申报申购、赎回业务。

投资人须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资人申购本基金时，须根据申购赎回清单备足申购对价；投资人提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。否则所提交的申购、赎回申请无效。

## 2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、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，或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，则赎回申请失败。

申购赎回代理券商受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、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。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购和赎回过程中涉及的申购赎回对价和基金份额的交收适用《业务规则》的规定。

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

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

如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《业务规则》和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

若投资者用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记机

构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。

4、如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行。基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 10.5 申购和赎回的数额限制

投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位为 50 万份，基金管理人有权对其进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限，具体规定请参见相关公告。

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份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。

基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整上述申购和赎回的数量或比例限制。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。

## 10.6 申购、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，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。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组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。

4、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.2% 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。

5、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，对基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间进行调整并提前公告。

## 10.7 申购赎回清单的内容与格式

本基金的基金份额申购与赎回包括场外实物申购赎回方式和场内申购赎回方式 2 种方式，将采用不同的申购赎回清单。

### （一）场外实物申购赎回方式

#### 1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单内容包括最小申购赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T 日预估现金差额、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

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

#### 3、现金替代相关内容

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

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

（1）现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

#### （2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券经除权调整的 T-1 日收盘价 × (1 + 现金替代保证金率)

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

### ③ 替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此在 T+2 日收取替代金额。

在 T+1 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+3 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+3 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+3 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T+1 日起，相关证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+3 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T+1 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人，现金替代多退少补资金的清算和交收在 T+3 日后 2 个工作日（若在特例情况下，则为 T+1 日起第 22 个交易日）内完成，登记机构对此提供代收代付服务。

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

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券数量} \times \text{该证券经除权调整的} T-1\text{日收盘价}}{\text{申购基金份额} \times T-1\text{日基金份额净值}}$$

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

### (3) 必须现金替代

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

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的 T-1 日收盘价。

#### 4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

$T$  日预估现金差额 =  $T-1$  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用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)

其中， $T$  日经除权调整后的开盘参考价主要根据深圳证券信息有限公司所提供的标的指数成份证券调整后开盘参考价确定。另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、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资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和)

当现金替代标志为禁止现金替代或可以现金替代时，若  $T$  日为某一股票除息、送股(转增)、配股等权益变动的权益登记日，由于  $T$  日投资者或基金资产将获得相应的权益，在上述公式中，基金管理人将以该股票经除权调整的  $T$  日收盘价为基础计算  $T$  日现金差额。

$T$  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

$T$  日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期：	XXXX 年 XX 月 XX 日
---------	------------------

基金名称:	南方国证交通运输行业交易型开放式指数 证券投资基金
基金管理公司名称:	南方基金管理股份有限公司
基金代码:	XXXXXX
标的指数代码:	XXXXXX
基金类型	跨市场 ETF

## T-1 日信息内容

现金差额:	XXXX. XX
最小申购、赎回单位资产净值:	XXXX. XX
基金份额净值:	XX. XX

## T 日信息内容

预估现金差额（单位：元）	XXXX. XX
最小申购、赎回单位（单位：份）	XX
T 日最小申购赎回单位分红金额（单位：元）	无
可以现金替代比例上限	XX%
申购赎回组合证券只数	XX
是否需要公布 IOPV	是
是否允许申购	是
是否允许赎回	是
当天累计可申购的基金份额上限	不设上限
当天累计可赎回的基金份额上限	不设上限

## 成份股信息内容

证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	现金替代折价比例	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
XXX		XX	允许	10.00%				深圳市场
XXX		0	必须	0.00%		XXX	XXX	深圳市场
...	...	...	...	...	...	...	...	...
XXX		0	必须	0.00%	0.00%	XXX	XXX	上海市场
...	...	...	...	...	...	...	...	...

XXX		XX	允许	10.00%	30.00%			上海市场
-----	--	----	----	--------	--------	--	--	------

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

## （二）场内申购赎回方式

### 1、申购赎回清单的内容

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

### 2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记结算机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

### 3、组合证券

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

### 4、现金替代相关内容

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

（1）现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于所有成份股。

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

当可以现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

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

(2) 可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和沪市成份证券。

1) 对于深市成份证券

①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券，或基金管理人认为可以适用的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券经除权调整的 T-1 日收盘价 × (1 + 现金替代保证金率)

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

③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

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

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人，现金替代多退少补资金的清算和交收在 T+2 日后 2 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 22 个交易日）内完成，登记机构对此提供代收代付服务。



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

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券数量} \times \text{该证券经除权调整的} T-1\text{日收盘价}}{\text{申购基金份额} \times T-1\text{日基金份额净值}}$$

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为n。

## 2) 对于沪市成份证券

①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结算机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的沪市成份证券，替代金额的计算公式为：

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

赎回替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 - 现金替代折价比例)

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的T-1日收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

“现金替代溢价比例”也称“现金替代保证金率”。申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取申购替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代折价比例，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

## ③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

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

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在上交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。

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

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

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

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

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

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

### (3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是因标的指数调整将被剔除；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原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的 T-1 日收盘价。

### 5、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

$T$  日预估现金差额 =  $T-1$  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用现金替代的固定替代金额之和 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)

其中， $T$  日经除权调整后的开盘参考价主要根据深圳证券信息有限公司所提供的标的指数成份证券调整后开盘参考价确定。另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

### 6、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资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额之和 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和)

当现金替代标志为禁止现金替代或可以现金替代时，若  $T$  日为某一股票除息、送股(转增)、配股等权益变动的权益登记日，由于  $T$  日投资者或基金资产将获得相应的权益，在上述公式中，基金管理人将以该股票经除权调整的  $T$  日收盘价为基础计算  $T$  日现金差额。

$T$  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。

## 7、申购赎回清单的格式

T 日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期：	XXXX年XX月XX日
基金名称：	南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称：	南方基金管理股份有限公司
基金代码：	XXXXXX
标的指数代码：	XXXXXX
基金类型	跨市场ETF

T-1 日信息内容

现金差额：	XXXX. XX
最小申购、赎回单位资产净值：	XXXX. XX
基金份额净值：	XX. XXXX

T 日信息内容

预估现金差额（单位：元）	XXXX. XX
最小申购、赎回单位（单位：份）	XX
T日最小申购赎回单位分红金额（单位：元）	无
可以现金替代比例上限	XX%
本市场申购赎回组合证券只数	XX
全部申购赎回组合证券只数	XX+1只（含“159900”证券）
是否需要公布IOPV	是
是否允许申购	是
是否允许赎回	是
当天累计可申购的基金份额上限	不设上限
当天累计可赎回的基金份额上限	不设上限

单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限	不设上限
当天净申购的基金份额上限	不设上限
当天净赎回的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天净申购的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限	不设上限

## 成份股信息内容

证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	现金替代折价比例	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
159900	申赎现金	0	必须			XXX	XXX	深圳市场
XXX		XX	允许	10.00%				深圳市场
XXX		0	必须	0.00%		XXX	XXX	深圳市场
...	...	...	...	...	...	...	...	...
XXX		0	必须	0.00%	0.00%	XXX	XXX	上海市场
...	...	...	...	...	...	...	...	...
XXX		XX	允许	10.00%	30.00%			上海市场

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

## 10.8 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、本基金进行交易的主要证券/期货交易所交易时间非正常停市，可能影响本基金投资运作，或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/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

8、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或基金管理人在开市后发现申购赎回清单编制错误或基金份额参考净值计算错误。

9、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限时。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项和第 9 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在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。

## 10.9 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、本基金进行交易的主要证券/期货交易所交易时间非正常停市，可能影响本基金投资运作，或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/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

7、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或基金管理人在开市后发现申购赎回清单编制错误或基金份额参考净值计算错误。

8、当日赎回申请超过基金管理人根据市场情况设置的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第4项和第8项以外的暂停赎回情形之一且基金管理人决定暂停赎回申请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。

#### 10.10 其他申购赎回方式

1、若基金管理人推出以本基金为目标ETF的联接基金（可能由基金管理人另行募集或由基金管理人已管理的其他证券投资基金转型而形成），本基金可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，不收取申购费用。

2、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，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业务，无需召开基金份额持有人大会。场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

3、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。

4、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则，集合申购业务的相关规则在开始执行前将予以公告。

5、在对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。

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

#### 10.11 基金的非交易过户

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

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

### 10.12 基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

### 10.13 基金份额的转让

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

### 10.14 其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

十五、基金合同生效后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金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在本基金招募说明书及其更新中予以更新，无须召开基金份额持有人大会审议。

## § 11 基金的投资



## 11.1 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 11.2 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，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可投资于存托凭证。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金管理人根据相关规定可参与融资、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。

## 11.3 投资策略

本基金主要采用完全复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。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%。

### 1、完全复制策略

本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

### 2、替代策略

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制无法投资某只成份股；（2）成份股流动性严重不足；（3）成份股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

### 3、金融衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

#### （1）股指期货投资策略

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

#### （2）股票期权投资策略

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

### 4、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。

### 5、可转换债券及可交换债券投资策略

本基金在可转换债券和可交换债券投资中预期运用仓位策略、类属策略、个券挖掘策略、条款价值策略、行权套利策略等多种策略，构建风险收益比佳、基本面稳健的组合。其中仓位策略和类属策略，将根据基本面环境、股债性价比，确定整体仓位水平、偏股型和偏债型可转债占比。个券挖掘策略，从基本面视角来挖掘可转债的机会，选择基本面景气向上、估值不高的偏股型转债作为获取超额收益的品种。条款价值策略，即深入分析修正转股价条款、回售条款和赎回条款等对转债价值的影响，挖掘各条款对应的投资机会。行权套利策略，可转债具备按照约定的价格转换为标的股票的权利，本基金将综合分析正股的基本面和估值水平、可转债的转股溢价率水平、可转债和标的股票的流动性、可转债转股对标的股票稀释和抛售压力等因素，确定是否行使将可转债转换为标的股票的权利，以及转股的时机和转股后标的股票的持有时间。

### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 7、融资及转融通证券出借业务投资策略

为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的需要参与融资及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、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

#### 8、存托凭证投资策略

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

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 11.4 投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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

（8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

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

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

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

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

(14) 本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

1) 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%；

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

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

(15) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 本基金在任何交易日日终，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%；

3) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按市值加权平均计算；

4) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

(16) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（6）、（9）、（10）、（15）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金参与转融通证券出借业务，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第（15）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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

如法律法规或监管部门对上述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。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）依照法律法规有关规定，由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的原则，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。相关交易必须先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门对上述限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

### 11.5 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为国证交通运输行业指数，及其未来可能发生的变更。

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。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 11.6 风险收益特征

本基金属股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 11.7 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。

### 11.8 基金投资组合报告

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

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2024 年 6 月 30 日（未经审计）。

### 11.8.1 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	68,936,228.14	99.48
	其中：股票	68,936,228.14	99.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.07	0.00
	其中：债券	1,000.07	0.00
	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	349,409.96	0.50
8	其他资产	6,665.51	0.01
9	合计	69,293,303.68	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 11.8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 11.8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	951,328.00	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	64,515,386.98	93.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,441,563.00	4.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-



O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	68,908,277.98	99.82

#### 11.8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,215.99	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,734.17	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,950.16	0.04

### 11.8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 11.8.3 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

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

金额单位：人民币元

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	601816	京沪高铁	1,690,100	9,075,837.00	13.15
2	601919	中远海控	418,450	6,481,790.50	9.39
3	002352	顺丰控股	167,200	5,967,368.00	8.64
4	601006	大秦铁路	649,500	4,650,420.00	6.74

5	600009	上海机场	81,600	2,631,600.00	3.81
6	600115	中国东航	617,300	2,475,373.00	3.59
7	601111	中国国航	294,500	2,173,410.00	3.15
8	600029	南方航空	320,800	1,889,512.00	2.74
9	600233	圆通速递	120,700	1,888,955.00	2.74
10	601021	春秋航空	33,400	1,881,422.00	2.73

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

金额单位：人民币元

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	603350	安乃达	350	7,196.00	0.01
2	688530	欧莱新材	206	3,316.60	0.00
3	688691	灿芯股份	77	3,273.27	0.00
4	688709	成都华微	157	2,950.03	0.00
5	688695	中创股份	78	2,460.90	0.00

### 11.8.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换 债）	1,000.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.07	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	113685	升 24 转债	10	1,000.07	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 11.8.7 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。

#### 11.8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资 明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 11.8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 11.8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 11.8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 11.8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 11.8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 11.8.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 11.8.11 投资组合报告附注

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

对相关证券的投资决策程序做出说明。

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

**11.8.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

**11.8.11.3 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,665.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,665.51

**11.8.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**11.8.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**11.8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603350	安乃达	7,196.00	0.01	新股未上市
2	688530	欧莱新材	3,316.60	0.00	新股锁定期
3	688691	灿芯股份	3,273.27	0.00	新股锁定期
4	688709	成都华微	2,950.03	0.00	新股锁定期
5	688695	中创股份	2,460.90	0.00	新股锁定期

### 11.9 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2022.11.23 -	1.80%	1.08%	1.59%	1.19%	0.21%	-0.11%
2022.12.31						
2023.1.1- 2023.12.31	-14.28%	0.83%	-16.59%	0.83%	2.31%	0.00%
2024.1.1- 2024.6.30	9.71%	1.05%	8.69%	1.05%	1.02%	0.00%
自基金成 立起至今	-4.27%	0.92%	-7.90%	0.93%	3.63%	-0.01%

## § 12 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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



## § 13 基金资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、银行存款本息、应收款项、衍生工具和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。

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

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

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

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

### 四、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未

发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一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。

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

本基金投资股票期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

6、基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规和中国证券投资基金业协会发布的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

7、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。

8、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

9、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，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人计算的基金净值信息的结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人与基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、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、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

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值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信息予以公布。

#### 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 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或由于证券/期货交易所、登记机构等第三方机构发送的数据错误等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## § 14 基金的收益与分配

### 一、基金收益分配原则

- 1、当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上时，可进行收益分配；
- 2、在符合有关基金收益分配条件的前提下，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除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 3、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配采取现金分红方式；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构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、标的指数同期累计报酬率。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

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 1 乘以 100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%。

期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算上述指标。

当上述超额收益率超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。

- 2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的可分配收益，并确定收益分配比例及收益分配数额。

### 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，在 2 日内在规定媒介公告。

#### 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人自行承担。

## § 15 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货/期权交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市初费及年费；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、因参与融资及转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支



付等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第3—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费应当由基金管理人承担，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

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。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。

## § 16 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《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在2日内在规定媒介公告。

## § 17 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 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、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。基金产品资料概要的正文应当包括产品概况、基金投资与净值表现、投资本基金涉及的费用、风险揭示与重要提示等中国证监会规定的披露事项，相关内容不得与基金合同、招募说明书有实质性差异。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3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网站上。

## （二）基金份额发售公告

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

## （三）《基金合同》生效公告

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

## （四）基金净值信息

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

#### （五）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并提前将公告登载于规定媒介上。

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

#### （六）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的3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。

#### （七）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站、申购赎回代理券商以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

#### （八）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15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

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

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

#### （九）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，并登载在规定的报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、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、本基金变更标的指数；
- 20、本基金停牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、本基金连续 30、40、45 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人民币 5000 万元情形的；

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和基金合同约定的其他事项。

#### （十）澄清公告

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

#### （十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十二）基金投资股指期货的信息披露

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

#### （十三）基金投资股票期权的信息披露

本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定投资政策和投资目标。

#### （十四）基金参与融资业务的信息披露

本基金在季度报告、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。

#### （十五）基金参与转融通证券出借业务的信息披露

本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与转融通证券出借交易情况，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。

#### （十六）基金投资资产支持证券的信息披露

本基金在中期报告、年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内所有的资产支持证券明细。本基金在季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十七）清算报告

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

#### （十八）本基金投资存托凭证的信息披露依照内地上市交易的股票执行。

（十九）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等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披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、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；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。



## § 18 风险揭示

本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险及其他风险等。

### 一、市场风险

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

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，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。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

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

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

9、投资股指期货的风险。本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

（1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

(2) 流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险：是指股指期货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。

(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股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(5) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(6) 信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

(7) 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。

10、投资股票期权的风险。股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

#### 11、本基金投资资产支持证券的风险。

本基金可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险。

(1) 信用风险也称为违约风险，它是指资产支持证券参与主体对它们所承诺的各种合约的违约所造成的可能损失。从简单意义上讲，信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

(2) 利率风险是指资产支持证券作为固定收益证券的一种，也具有利率风险，即资产支持证券的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

(3) 流动性风险是指资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

(4) 提前偿付风险是指若合同约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

(5) 操作风险是指相关各方在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

(6) 法律风险是指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

#### 12、本基金投资流通受限证券的风险。

本基金可投资于流通受限证券，因此可能面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险，同时由于流通受限证券的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定期限内无法流通，在面临基金大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。目前，本基金管理人

已建立了健全的内部控制体系，全面监控流动性受限证券的种类、投资比例、内部审批流程、信息披露、日常风险监控等环节，做好危机处理预案，确保流通受限证券投资的合法合规。

### 13、本基金参与转融通证券出借业务的风险

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、支付赎回款项的风险；

#### （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

根据转融通证券出借业务的特点，基金管理人配备了风控、合规、投资、后台等专业的技术人员、升级改造了相关技术系统，制定了参与转融通证券出借业务的投资策略、搭建了健全合理的转融通业务内部控制体系，包括严密完备的管理制度、科学规范的业务控制流程、清晰明确的组织体系与职责分工、灵活有效的风险应对安排，制定或更新了相关风险管理制度，完善了开展转融通出借业务的相关安排，保障转融通出借业务的顺利开展。

除上述风险外，基金管理人参与转融通证券出借业务还应关注外部监管机构或公司要求关注的其他风险。

## 二、管理风险

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

## 三、流动性风险

### （1）本基金交易方式带来的流动性风险

①本基金最小申购赎回单位设置较高（目前为 50 万份），中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

②基金将在深圳证券交易所上市交易，但不保证市场交易一定活跃；基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

③尽管由于投资者可以进行申购、赎回，基金一般不会持续出现大幅折溢价情况。但是，基金的二级市场交易价格受市场供求的影响，可能高于（称为溢价）或低于（称为折价）基金份额净值。

#### （2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在证监会及相关法律法规规定的合法范围之内，且一般具备良好的市场流动性和可投资性。本基金投资范围的设定也合理、明确，操作性较强。本基金为被动式指数基金，主要投资的标的指数成份股和备选成份股以最近一年无重大违法违规事件，财务报告无重大问题，信息披露、公司内控等方面治理规范，股价无明显的异常波动或市场操纵，非ST、\*ST股票以及非暂停上市的A股股票为样本空间。且本基金已依照指数权重进行了分散投资，以上均为基金平稳运作提供了良好的基础。根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金将审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

#### （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

本基金为交易型开放式基金，将依据市场最新流动性情况，在申购赎回清单中设定适当的每日赎回上限，以尽量规避巨额赎回导致的流动性风险。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人将时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按基金合同约定的时限支付赎回对价。

### 四、本基金特有的风险

#### 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、投资人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及跟踪误差控制未达约定目标的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或

摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。但因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策可能改变，投资组合需随之调整，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。

#### 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

#### 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担后果。

#### 7、投资人赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人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。若基金管理人设置当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，投资人可能无法赎回的风险。

#### 8、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

#### 9、退市风险

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

#### 10、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

(2) 登记机构可能调整结算制度，对投资者基金份额、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/期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### (4) 指数编制机构停止服务的风险

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

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

#### 11、成份股停牌、摘牌的风险

标的指数的当前成份股可能会改变、停牌或摘牌，此后也可能会有其它股票加入成为该指数的成份股。本基金投资组合与相关指数成份股之间并非完全相关，在标的指数的成份股调整时，存在由于成份股停牌或流动性差等原因无法及时买卖成份股，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。当标的指数的成份股摘牌时，本基金可能无法及时卖出而导致基金净值下降，跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

本基金运作过程中，当标的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，基金管理人应当按照基金份额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，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响，当基金管理人对该成份股予以调整时也可能产生跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

#### 12、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原因可能引致风险，例如，申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为、交易错误、IT系统故障等风险。

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

#### 13、基金合同提前终止的风险

《基金合同》生效后，连续 50 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

#### 14、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括中国存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### 五、其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

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

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

## § 19 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、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) 聘请符合《证券法》规定的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。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金财产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

#### 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 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

## § 20 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （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和转融通证券出借业务；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金相关费率结构和收费方式；
- （17）自行或委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
- （18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

（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不少于法律法规规定的最低年限；

（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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束30日内退还基金认购人；投资者以股票认购的，相关股票的解冻按照《业务规则》的规定处理；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

（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，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(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；

(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不少于法律法规规定的最低年限；

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

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

若以本基金为目标ETF的联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额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，联接基金的基金份额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持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、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）终止基金上市，但本基金合同另有约定的除外；
- （11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （12）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；
- （13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法規規定和《基金合同》約定的範圍內且對基金份額持有人利益無實質性不利影響的前提下，以下情況可由基金管理人和基金託管人協商後修改，不需召開基金份額持有人大會：

- （1）法律法規要求增加的基金費用的收取；
- （2）調整本基金的申購費率、調低贖回費率、變更收費方式；
- （3）基金管理人、相關證券交易所、登記機構、銷售機構調整有關基金認購、申購、贖回、交易、非交易過戶、收益分配、信息披露等業務的規則，基金推出新業務或服務；
- （4）增加、減少或調整基金份額類別設置及對基金份額分類辦法、規則進行調整；
- （5）因相應的法律法規、深圳證券交易所或者登記機構的相關業務規則發生變動而應當對《基金合同》進行修改；
- （6）對《基金合同》的修改對基金份額持有人利益無實質性不利影響或修改不涉及《基金合同》當事人權利義務關係發生重大變化；
- （7）按照法律法規和《基金合同》規定不需召開基金份額持有人大會的其他情形。

（二）會議召集人及召集方式

1、除法律法規規定或《基金合同》另有約定外，基金份額持有人大會由基金管理人召集。

2、基金管理人未規定召集或不能召集時，由基金託管人召集。

3、基金託管人認為有必要召開基金份額持有人大會的，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開；基金管理人決定不召集，基金託管人仍認為有必要召開的，應當由基金託管人自行召集，並自出具書面決定之日起 60 日內召開並告知基金管理人，基金管理人應當配合。

4、代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人就同一事項書面要求召開基金份額持有人大會，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開；基金管理人決定不召集，代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人仍認為有必要召開的，應當向基金託管人提出書面提議。基金託管人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金管理人；基金託管人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開，並告知基金管理人，基金管理人應當配合。

5、代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人就同一事項要求召開基金份額持有人大會，而基金管理人、基金託管人都不召集的，單獨或合計代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人有權自行召集，並至少提前 30 日報中國證監會備案。基金份額持有



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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规或监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

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

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

### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

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。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表

决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

- 1、当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上时，可进行收益分配；
- 2、在符合有关基金收益分配条件的前提下，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除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 3、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配采取现金分红方式；
- 5、每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构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，在2日内在规定媒介公告。

#### （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金的证券/期货/期权交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市初费及年费；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、因参与融资及转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 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，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

### （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，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、衍生

工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可投资于存托凭证。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金管理人根据相关规定可参与融资、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。

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

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

（8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

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

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

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

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

(14) 本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

1) 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%；

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

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

(15) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 本基金在任何交易日日终，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%；

3) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按市值加权平均计算；



4) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

(16) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（6）、（9）、（10）、（15）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金参与转融通证券出借业务，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第（15）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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

如法律法规或监管部门对上述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。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）依照法律法规有关规定，由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的原则，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。相关交易必须先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门对上述限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

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

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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) 聘请符合《证券法》规定的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。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金财产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

#### （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5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

## 八、争议解决方式

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

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

《基金合同》受中国法律（为《基金合同》之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

## 九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式两份外，基金管理人、基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

5、《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。

## § 21 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：南方基金管理股份有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

邮政编码：518048

法定代表人：周易

成立日期：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基字[1998]4 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 3.6172 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应严格按照基金托管人要求的格式，基金管理人应将拟投资的标的证券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督。

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，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可投资于存托凭证。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金管理人根据相关规定可参与融资、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。

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

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

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

(8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(10) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(11) 每个交易日日终, 在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(12) 本基金参与股指期货交易, 应当符合下列投资限制:

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

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

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

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

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

(13) 本基金参与股票期权交易, 应当符合下列投资限制:

1) 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%;

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

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

(14) 本基金参与转融通证券出借业务的, 应当符合下列要求:

1) 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 本基金在任何交易日日终，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%；

3) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按市值加权平均计算；

4) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

(15) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第(6)、(9)、(14)项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金参与转融通证券出借业务，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第(14)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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

如法律法规或监管部门对上述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。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第(九)款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供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供的银行间债券市场交易对手名



单进行交易（若基金管理人未提供交易对手名单，则视同可与所有交易对手进行交易）。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作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，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前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或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金，若有最新监管政策根据最新政策进行。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，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，基金托管人不不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

（1）中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

（2）非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

（3）非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

（4）基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本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。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

（1）本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

（2）在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

（3）有关比例限制的执行情况。

（4）信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

（七）基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，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。

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒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。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（九）基金管理人有权配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《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。

（十）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，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### 三、基金管理人应对基金托管人的业务核查

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

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

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠

对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中。该账户由基金管理人开立并管理。募集的股票按照交易所和注册登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，注册登记机构应将网下股票认购所募集到的股票划入以基金托管人和基金联名方式开立的证券账户下，同时在规定时间内，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。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，发售代理机构应予以解冻。

##### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

5. 基金管理人应于基金终止运作后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转，在确保后续不再发生款项进出后的 10 个工作日内向基金托管人发出销户申请。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待本基金启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5. 账户注销时，在遵守中国证券登记结算有限责任公司的相关规定下，由基金管理人和基金托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

6. 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，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结

算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助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。

2. 本基金在开始进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

本基金如需参加期权交易，应当按照现有证券账户开立方式向中国证券登记结算有限责任公司申请新开立一个普通证券账户，基金管理人负责将该证券账户指定交易在证券公司或期货公司，由相应证券公司（或期货公司）为本基金开立衍生品合约账户后，再通过该证券公司（或期货公司）参与期权交易。

3. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不少于法律法规规定的最低年限。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、银行存款本息、应收款项、衍生工具和其他投资等资产及负债。

### 2. 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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

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

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

(4) 同一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。

(5) 本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。本基金投资股票期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

(6) 基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规和中国证券投资基金业协会发布的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

(7) 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。

(8) 本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

(9) 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見的，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人计算的结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力，或由于证券/期货交易所、登记机构等第三方机构发送的数据错误等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金



托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于法律法规规定的最低年限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

本协议受中国法律（不含港澳台地区法律）管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止的情形

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

### （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) 聘请符合《证券法》规定的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。

6. 清算费用

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

7. 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。

8. 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5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

9. 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不少于法律法规规定的最低年限。

## § 22 基金份额持有人服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

若本基金包含在中国香港特别行政区销售的H类份额，则该H类份额持有人享有的服务项目一般情况下限于客户服务中心电话服务、投资人投诉及建议受理服务和网站资讯等服务。

### 一、网上开户及交易服务

投资人可通过基金管理人网站（www.nffund.com）、微信公众号（可搜索“南方基金”或“NF4008898899”）或APP客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

### 二、信息查询及交易确认服务

#### （一）基金信息查询服务

投资人通过基金管理人网站等平台可享有基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括基金名称、管理人名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值、收益情况等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

#### （二）基金交易确认服务

基金管理人以电子邮件、微信或其他与投资人约定的形式及时向通过基金管理人直销渠道投资并持有本公司基金份额的持有人告知其认购、申购、赎回的基金名称以及基金份额的确认日期、确认份额和金额等信息。基金份额持有人通过非直销销售机构办理基金管理人基金份额交易业务的，相关信息确认服务请参照各销售机构实际业务流程及规定。

### 三、基金保有情况信息服务

基金管理人至少每年度以电子邮件、微信或其他与投资人约定的形式向通过基金管理人直销渠道投资并持有基金管理人基金份额的持有人提供基金保有情况信息。

基金份额持有人可通过以下方式订阅或查阅基金保有情况信息：

1、基金份额持有人可通过基金管理人网站、客服电话等方式定制电子邮件形式的定期对账单。

2、基金份额持有人可关注基金管理人微信公众号并绑定账户，定期接收微信对账单。

3、基金份额持有人可登录本基金管理人网站（www.nffund.com）查阅及下载基金保有情况及对账单。

4、基金份额持有人可前往销售机构交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务等渠道查询基金保有情况信息。

由于投资人预留的联系方式不详、错误、未及时变更，未关注微信公众号或者关注后未绑定账号，通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资人，敬请及时通过基金管理人网站，或拨打基金管理人客服热线查询、核对、变更预留联系方式。

#### 四、资讯服务

投资人知悉并同意基金管理人可根据投资人的个人信息不定期通过电话、短信、邮件、微信等任一或多种方式为投资人提供与投资人相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息、客户关怀等资讯及增值服务，投资本基金前请详阅南方基金官网服务介绍和隐私政策。如需取消相应资讯服务，可按照相关指引退订，或通过基金管理人客户服务中心热线 400-889-8899、在线服务等人工服务方式退订。

#### 五、客户服务中心电话及在线服务

##### （一）电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-889-8899 可享有如下服务：

- 1、自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。
- 2、人工服务：提供每周 7 日，每日不少于 8 小时的人工服务（春节假期除外）。投资人可以通过该热线获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

##### （二）在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端可享有如下服务：

- 1、智能客服服务（7×24 小时）：提供业务规则、净值信息等自助咨询服务。
- 2、人工服务：提供每周 7 天，每天不少于 8 小时的人工服务（春节假期除外）。投资人可通过该方式获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

#### 六、投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

## § 23 其他应披露事项

标题	公告日期
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国盛证券为一级交易商的公告	2024-09-03
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	2024-08-31
关于南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	2024-08-26
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东吴证券为一级交易商的公告	2024-08-21
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加光大证券为一级交易商的公告	2024-08-20
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华鑫证券为一级交易商的公告	2024-08-07
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	2024-07-26
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	2024-07-19
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	2024-07-05
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加湘财证券为一级交易商的公告	2024-05-29
关于调整证券投资基金主流流动性服务商的公告	2024-04-24
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	2024-04-22
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国金证券为一级交易商的公告	2024-04-16
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	2024-03-30
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	2024-03-13
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加西南证券为一级交易商的公告	2024-02-26
南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	2024-02-24
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加申万宏源西部为一级交易商的公告	2024-02-07
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加申万宏源为一级交易商的公告	2024-02-07
关于南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	2024-02-02

南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	2024-02-02
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加财达证券为一级交易商的公告	2024-01-25
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	2024-01-22
南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加中原证券为一级交易商的公告	2024-01-18
南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	2024-01-06
关于指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	2024-01-05
南方基金关于旗下部分基金增加金元证券为场内申购赎回代理券商的公告	2023-12-04
南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	2023-12-01
南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	2023-10-25

注：其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告

## § 24 招募说明书存放及其查阅方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## § 25 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方国证交通运输行业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；
- 7、《南方国证交通运输行业交易型开放式指数证券投资基金登记结算服务协议》；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

南方基金管理股份有限公司

2024年10月23日