

华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

更新的招募说明书

2025 年第 1 号

(基金经理变更)

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇二五年一月

# 华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）

## 重要提示

华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 3 月 31 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》（证监许可【2015】508 号）进行募集。本基金的基金合同于 2015 年 5 月 13 日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金的标的指数为中证 500 指数，指数编制方案简介如下：

### 1、样本空间

同沪深 300 指数的样本空间，指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、\*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

科创板证券：上市时间超过一年。

创业板证券：上市时间超过三年。

其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

### 2、选择方法

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

对样本空间内剩余证券按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前 500 的证券作为指数样本。

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

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格

产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金是跟踪中证 500 指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体详见本招募说明书中“基金的风险揭示”章节。

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

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、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书中“基金的风险揭示”章节。

本基金申购赎回的方式有两种：场内申购赎回和场外申购赎回。对于场内申购，投资者当日申购的基金份额，当日可以卖出，但不得赎回；当日买入的基金份额，当日可以赎回，但不得卖出；当日赎回的证券，当日可以卖出，但不得用于申购基金份额；当日买入的证券，当日可以用于申购基金份额，但不得卖出。

对于场外申购赎回，申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整。投资者在办理场外申购、赎回业务时之前仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本次招募说明书更新主要涉及基金经理变更，并已对相应内容做出了更新，基金管理人相关信息截止日为 2025 年 1 月 23 日。除非另有说明，本更新招募说明书所载其余内容截止日为 2024 年 05 月 31 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2024 年 03 月 31 日，财务和业绩表现

数据未经审计。

## 目录

一、绪言.....	6
二、释义.....	7
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集.....	33
七、基金合同的生效.....	40
八、基金份额折算与变更登记.....	41
九、基金份额的交易.....	43
十、基金份额的申购与赎回.....	45
十一、基金的投资.....	72
十二、基金的业绩.....	82
十三、基金的财产.....	84
十四、基金资产的估值.....	85
十五、基金的收益与分配.....	89
十六、基金的费用与税收.....	91
十七、基金的会计与审计.....	94
十八、基金的信息披露.....	95
十九、基金的风险揭示.....	101
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	107
二十一、基金合同的内容摘要.....	109
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	122
二十三、对基金份额持有人的服务.....	133
二十四、其他应披露事项.....	134
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	136
二十六、备查文件.....	137

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》、《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》”）等有关法律法规以及《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会注册。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。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”
- 16、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟

踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、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

19、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

20、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

21、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

22、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

24、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

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

26、销售机构：指华泰柏瑞基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

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

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

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

30、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

32、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换或转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

33、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

34、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

35、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

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、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

39、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数

40、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

41、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

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

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

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

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

46、场外：指不通过上海证券交易所交易系统而通过销售机构自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的场所

47、场内：指通过上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所

48、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告的申购对价、赎回对价等信息的文件，适用场内份额的申购、赎回

49、组合证券：指标的指数所包含的全部或部分证券

50、申购对价：指在场内申购赎回方式下，投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

51、赎回对价：指在场内申购赎回方式下，投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

52、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证 500 指数及其未来可能发生的变更

53、完全复制法：指一种跟踪指数的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合，达到复制指数的目的

54、现金替代：指在场内申购赎回方式下，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

55、现金差额：指在场内申购赎回方式下，最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、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、预估现金差额：指在场内申购赎回方式下，由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结

57、基金份额参考净值：指基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

58、最小申购、赎回单位：指在场内申购赎回方式下，申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

59、基金份额折算：建仓结束后，基金管理人根据基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为

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

61、收益评价日：指基金管理人计算累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之日

62、基金累计报酬率：收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去 100%

63、标的指数同期累计报酬率：收益评价日的指数收盘值与基金份额折算日的指数收盘值之比减去 100%

64、元：指人民币元

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

66、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

67、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

68、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

69、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

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

71、货币市场工具：指现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

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

73、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

74、基金产品资料概要：指《华泰柏瑞中证 500 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

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001 年 7 月至 2016 年 11 月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

陆春光先生：董事，学士，2009 年 5 月加入华泰证券，曾任网络金融部互联网运营团队负责人、用户体验与设计团队负责人、副总经理，现任华泰证券上海分公司总经理。

Kirk Chester SWEENEY 先生：董事，学士，1982 年 9 月加入 United States Trust Co of NY，1984 年至 1988 年任 Drexel Burnham Lambert 副总裁，1988 年至 1990 年任 Morgan Stanley (纽约) 副总裁，1990 年至 1992 年任 Wardley-Thomson Securities (香港) 董事，1992 年至 2008 年任雷曼兄弟亚洲 (香港) 董事总经理兼香港地区负责人，2009 年至 2010 年任野村证券 (香港) 董事总经理，2010 年至 2013 年任巴克莱资本 (香港) 董事总经理，2013 年至 2019 年任 Millennium Capital Management (香港/新加坡) Pte Ltd 亚洲首席执行官，2019 年至 2020

年任泓策投资管理有限公司总裁，2020 年至 2021 年任 ExodusPoint Capital Management Hong Kong, Limited 亚洲区主管兼香港首席执行官，2021 年至今任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲首席执行官。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限公司，1992 年 4 月至 1996 年 12 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997 年 1 月至 2001 年 7 月任 AIG 友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001 年 7 月至 2010 年 2 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理。2010 年 2 月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007 年 7 月至 2011 年 9 月任华安基金管理有限公司副总经理。2011 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

李晗女士：独立董事，硕士，2007 年加入天元律师事务所，2015 年至今任该律师事务所合伙人。

田中荣治先生：独立董事，硕士，曾任职于野村证券株式会社、瑞穗证券亚洲有限公司、野村国际（香港）有限公司、野村资产管理香港有限公司。2022 年 9 月至今任中国国际金融日本株式会社代表取缔役社长。

孙茂竹先生：独立董事，硕士，1987 年 6 月至 2019 年 2 月任中国人民大学商学院教授、博士生导师。2019 年 2 月从中国人民大学退休。

尹雷先生：独立董事，硕士，曾任深圳证券交易所经理、麦顿投资副总裁、凯鹏华盈基金执行董事、阿里巴巴集团投资总监、阿里巴巴影业集团副总裁、海南阿里影业文化产业基金总裁，2019 年至今任厦门云尚汇影影视文化有限公司董事长。

## 2、监事会成员

刘晓冰先生：监事长，二十八年证券从业经历。1993 年 12 月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

卢龙威先生：监事，学士，曾任职于毕马威会计师事务所、安永会计师事务所、华为技术有限公司、荷兰银行（香港）、英美烟草（香港）有限公司、苏格兰皇家银行（香港），2014 年 10 月加入柏瑞投资亚洲有限公司，现任柏瑞投资亚洲有限公司全球税务主管兼亚太区财务总监。

刘声先生：监事，硕士。2011 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任风险管理部副总监。

赵景云女士：监事，硕士。2006 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金事务部

总监。

### 3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007 年 7 月至 2011 年 9 月任华安基金管理有限公司副总经理。2011 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004 年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监，2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 11 月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 11 月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

刘万方先生：督察长，财政部财政科学研究所财政学博士。曾任中国普天信息产业集团公司项目投资经理，美国 MBP 咨询公司咨询顾问，中国证监会主任科员、副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长，朱雀股权投资管理股份有限公司副总经理，朱雀基金管理有限公司总经理。2019 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司督察长。

满黎先生：副总经理，硕士。曾任华安基金管理有限公司北京分公司高级董事总经理，国

联安基金管理有限公司副总经理，金鹰基金管理有限公司副总裁，万家基金管理有限公司副总经理。2021 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任副总经理。

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998 年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004 年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任首席信息官兼信息技术部总监。

裴晓思先生：副总经理，复旦大学硕士。曾任泰和诚医疗集团行业研究员，中国出口信用保险公司投资经理，永诚财产保险有限公司投资经理，易方达基金管理有限公司非银客户部总经理助理（主持工作），2021 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司副总经理。

周俊梁先生：财务总监，硕士。曾任普华永道中天会计师事务所审计经理、渣打银行（中国）有限公司财务部高级经理、大华银行（中国）有限公司财务部第一副总裁，2015 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司财务总监。

柳军先生：副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业

交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

王文慧女士：副总经理，经济学硕士。2005 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任第一营销中心总监、第二营销中心总监、机构理财部总监、机构业务一部总监、华中营销中心总监、券商业务部总监、总经理助理兼券商业务部总监，现任公司副总经理兼券商业务部总监。

#### 4、本基金基金经理

胡亦清先生，硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

本基金历任基金经理：

柳军先生，自 2015 年 05 月至 2025 年 1 月任本基金的基金经理。

#### 5、权益投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理田汉卿女士；总经理助理沈雪峰女士；总经理助理董辰先生；总经理助理莫倩女士；主动权益投资总监方纬先生；投资一部总监杨景涵先生；主动权益投资副总监吕慧建先生。

列席人员：督察长或风险管理部总监可列席投资决策委员会会议。总经理可以提名其他人员列席投资决策委员会会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；

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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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；

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

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、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；

13、中国证监会规定的其它职责。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（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) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

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

(7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

- (8) 违反证券交易场所业务规则, 利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;
- (9) 贬损同行, 以抬高自己;
- (10) 以不正当手段谋求业务发展;
- (11) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

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

- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- (1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位, 并渗透到各项业务过程,

涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(2) 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；

(3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

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

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### (2) 风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

### (3) 控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

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

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2024 年 3 月 31 日，中国银行已托管 1093 只证券投资基金，其中境内基金 1032 只，QDII 基金 61 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先

后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### (一) 申购赎回代理证券公司（一级交易商）

(1) 名称：东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：戴彦

联系人：付佳

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

(2) 名称：国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

客服电话：95310

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

(3) 名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：95521

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

(4) 名称：天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：中国武汉武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

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

(5) 名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

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

(6) 名称：方正证券股份有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 15-19 层

法定代表人：施华

客服电话：95571

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

(7) 名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号 凯恒中心 B 座 16 层

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

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

(8) 名称：万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：王达

客服电话：95322

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

(9) 名称：山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：王怡里

客服电话：400-666-1618、(0351) 95573

公司网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(10) 名称：东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：95330

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



(11) 名称：德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市福山路 500 号 26 楼

办公地址：上海市福山路 500 号 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：400-888-8128

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

(12) 名称：中信证券华南股份有限公司

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

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

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

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

(13) 名称：华金证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 1902 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 27 层（陆家嘴世纪金融广场 2 号楼）

法定代表人：燕文波

客户服务电话：956011

公司网站：<https://www.huajinsc.cn>

(14) 名称：中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

客服电话：400-910-1166

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

(15) 名称：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)12、15 层

法定代表人：李娟

客服电话：95309

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

(16) 名称：第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(17) 名称：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

(18) 名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(19) 名称：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼机构事业部

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(20) 名称：开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客服电话：4008608866

公司网址：www.kysec.cn

(21) 名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：杨玉成

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(22) 名称：西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：徐朝晖

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

(23) 名称：华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(24) 名称：华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

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

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(25) 名称：华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：章宏韬

客服电话：400-809-6518（全国） 96518（安徽）

公司网址：www.hazq.com

(26) 名称：上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：何伟

客服电话：400-891-8918

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

(27) 名称: 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市生态大街 6666 号

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

客服电话: 95360

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

(28) 名称: 南京证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 389 号

办公地址: 南京市江东中路 389 号

法定代表人: 李剑锋

客服电话: 95386

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

(29) 名称: 财达证券股份有限公司

注册地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

法定代表人: 翟建强

客服电话: 95363

公司网址: [www.s10000.com](http://www.s10000.com)

(30) 名称: 申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人: 王献军

客服电话: 95523 或 4008895523

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

(31) 名称: 中国银河证券股份有限公司

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

办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人: 王晟

客服电话: 4008-888-888、95551

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

(32) 名称: 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客服电话：96336（浙江），400-869-6336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

(33) 名称：华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

客服电话：021-68777222

公司网址：www.cnhbstock.com

(34) 名称：浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服电话：（0571）95345

公司网址：www.stocke.com.cn

(35) 名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(36) 名称：民生证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 8 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 8 号

法定代表人：景忠

联系人：刘玥

电话：021-80508592

传真：010-85127641

客服电话：95376

公司网址：www.msyzq.com

(37) 名称：江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 5 6 号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 5 6 号

法定代表人：赵洪波

客服电话：0451-85863673

公司网址：www.jhzq.com.cn

(38) 名称：信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(39) 名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(40) 名称：中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：肖海峰

客服电话：95548

公司网址：sd.citics.com

(41) 名称：中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

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

法定代表人：高涛

客服电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

(42) 名称：联储证券股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层

办公地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层

法定代表人：吕春卫

客服电话：0532-80958800

公司网址：www.lczq.com

(43) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：肖海峰

客服电话：0532-85022313

公司网址：www.sd.citics.com/

(44) 名称：方正证券承销保荐有限责任公司

注册地址：北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-203 室

办公地址：北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-203 室

法定代表人：袁玉平

客服电话：95571

公司网址：www.fzfinancing.com

(45) 名称：中国证券金融股份有限公司

注册地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 12 层 1201

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 12 层 1201

法定代表人：陈飞

客服电话：010-63211666

公司网址：www.csf.com.cn

## (二) 登记机构

### 1、场内份额的登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：郑奕莉

电话：（021）58872935

传真：（021）68870311

## 2、场外份额的登记机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

电话：400-888-0001，（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：赵景云

### （三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：刘佳

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：单峰、胡莲莲

联系人：胡莲莲

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800



## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经 2015 年 3 月 31 日中国证监会《关于准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》（证监许可【2015】508 号）注册募集。

### （一）基金类型

股票型指数证券投资基金

### （二）基金存续期

不定期

### （三）募集方式和销售场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

具体销售名单、销售机构联系方式以及发售方案以发售公告为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

### （四）募集期限

本基金自 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日公开发售。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售，并及时公告。本基金的实际发售时间为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日。

## （五）募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## （六）基金的最低募集份额总额及金额

本基金的募集份额总数应不少于 2 亿份，基金募集金额总额（含网下股票认购所募集的股票市值）应不少于 2 亿元人民币。

## （七）基金的面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，以初始面值发售。

## （八）投资人对基金份额的认购

### 1、认购时间安排

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日进行发售。其中，网下现金发售的日期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日，网上现金发售的日期为 2015 年 5 月 4 日至 2015 年 5 月 6 日，网下股票发售的日期为 2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日。

### 2、认购开户

投资者认购本基金时需具有证券账户，证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或基金账户。

#### 1) 如投资者需新开立证券账户，则应注意：

① 基金账户只能进行基金的二级市场交易；如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

#### ② 开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

#### 2) 如投资者已开立证券账户，则应注意：

① 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

② 当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购的 1 个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

### 3、认购费用

认购费用由投资者承担，认购费率如下表所示：

认购份额 M (份)	认购费率
M < 50 万	1.0 %
50 万 ≤ M < 100 万	0.5%
M ≥ 100 万	1000 元/次

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于 1.0% 的标准收取一定的佣金。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、登记结算费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

#### 4、网上现金认购

1) 认购时间：2015 年 5 月 4 日至 2015 年 5 月 6 日上午 9:30—11:30 和下午 1:00—3:00。

2) 通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

3) 认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者应以上海证券账户认购，可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4) 认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5) 清算交收：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

6) 认购确认：在募集期结束后 3 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

#### 5、网下现金认购

1) 认购时间：2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2) 认购金额和利息折算的份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额

的计算公式为：

认购费用 = 认购份额 × 认购费率

认购金额 = 认购份额 × (1 + 认购费率)

净认购份额 = 认购份额 + 认购金额产生的利息 / 基金份额面值

其中：

认购费用由基金管理人在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3) 认购限额：网下现金认购以基金份额申请。

投资者以上海证券账户通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍，投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4) 认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5) 清算交收：

T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于 T+2 日内进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第 4 个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金管理人预先开设的基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资者所有。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。其中，认购款项不计利息。

6) 认购确认：在募集期结束后 3 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

6、网下股票认购

1) 认购时间：2015 年 4 月 15 日至 2015 年 5 月 6 日，具体业务办理时间由指定发售机构确定。

2) 认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证 500 指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资者应以 A 股账户认购，可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3) 认购手续: 投资者在认购本基金时, 需按销售机构的规定, 到销售网点办理认购手续, 并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销。

4) 特殊情形

(1) 已公告的将被调出中证 500 指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模: 基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况, 决定是否对个股认购规模进行限制, 并在网下股票认购日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。认购规模受限的个股一般不超过 50 只。

(3) 临时拒绝个股认购: 对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股, 基金管理人可不经公告, 全部或部分拒绝该股票的认购申报。

5) 清算交收: 每日日终, 发售机构将当日的股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人, 网下股票认购最后一日, 基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者账户内相应的股票进行冻结。基金募集期结束后, 基金管理人根据发售机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的认购费用\佣金, 并从投资者的认购份额中扣除, 为发售机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记, 并根据基金管理人确认的认购申请股票数据, 按照交易所和登记机构的规则和流程, 最终将投资者申请认购的股票过户到基金的证券账户。

6) 认购份额的计算公式:

投资者的认购份额 =  $\sum_{i=1}^n$  (第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 × 有效认购数量) / 1.00

其中,

(1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票, 如投资者仅提交了 1 只股票的申请, 则 i=1, i ≤ 500。

(2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据, 以该股票的总成交金额除以总成交股数计算, 以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交, 则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动, 则由于投资者获得了相应的权益, 基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

①除息: 调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

③配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股配股比例）

④送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

⑤除息且送股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价—每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例）

⑥除息且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例—每股现金股利或股息）/（1+每股配股比例）

⑦除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例—每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中，

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

$$q^{\max} = (\text{Cash} + \sum_{j=1}^n p_j q_j) \times 105\% \times w / p$$

$q^{\max}$  为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量，Cash 为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额， $p_j q_j$  为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积， $w$  为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日中证 500 指数中的权重（认购期间如有中证 500 指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及中证 500 指数编制规则计算调整后的中证 500 指数构成权重，并以其作为计算依据）， $p$  为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

②若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

### （九）募集期认购资金、股票及利息的处理方式

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

募集的股票由登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。对于用于认购本基金的股票，在冻结期间的权益归投资者所有。

#### **(十) 募集结果**

本基金募集工作于 2015 年 5 月 6 日顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 873,771,921.00 元人民币，折合基金份额 873,771,921.00 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 48,140.00 元人民币，折合基金份额 48,140.00 份。本次募集所有资金已于 2015 年 5 月 12 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 10,878 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 873,820,061.00 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。按照有关法律规定，本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》、《招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2015 年 5 月 13 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

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

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

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息，同时将已冻结的股票解冻；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。



## 八、基金份额折算与变更登记

### （一）基金份额折算的时间

基金合同生效后，基金管理人应逐步调整实际组合直至达到跟踪指数要求，此过程为基金建仓。基金建仓期不超过 3 个月。

基金建仓结束后，基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。本基金进行基金份额折算的，基金管理人确定基金份额折算日，并提前公告。

### （二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算日的指数收盘值的一定比例基本一致。具体比例由基金管理人在相关公告中规定。

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。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，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

#### 1、基金份额折算程序与计算公式

1) 基金管理人确定基金份额折算日（T 日），并提前公告。

2) T 日收市后，基金管理人计算当日的基金资产净值 X、基金份额总额 Y，并与基金托管人进行核对。

3) 假设 T 日标的指数收盘值为 I，折算比例为 1/Z，则 T 日的目标基金份额净值为 I/Z，基金份额折算比例的计算公式为：

折算比例 =  $(X/Y) / (I/Z)$ ，以四舍五入的方法保留小数点后 8 位。

4) 基金管理人根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算，折算后的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位，加总得到折算后的基金份额总额。基金管理人将折算后的各基金份额持有人持有的基金份额数据发送给登记机构，并将折算后的基金份额总额数据发送给基金托管人。

5) 登记机构根据基金管理人提供的数据为基金份额持有人进行基金份额的变更登记。

6) 基金管理人、基金托管人根据折算后的基金份额总额，进行相应的会计处理，计算 T

日折算后的基金份额净值，并互相核对。

7) T+1 日，基金管理人公告折算比例及折算后的基金份额净值。投资者可以在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额。

## 2、基金份额折算的举例

假设某投资者在基金募集期内认购了 5,000 份，基金份额折算日的基金资产净值为 3,127,000,230.95 元，折算前的基金份额总额为 3,013,057,000 份，当日标的指数收盘值为 5,633.29，折算比例为 1/10,000。

1) 折算比例 =  $(3,127,000,230.95 / 3,013,057,000) / (5,633.29 / 10,000) = 1.84229196$

2) 该投资者折算后的基金份额 =  $5,000 \times 1.84229196 = 9,211$

## 九、基金份额的交易

### （一）基金上市

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

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

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定，包括但不限于：

- 1、基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值；
- 2、基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、基金买入申报数量为 100 份或其整数倍，不足 100 份的部分可以卖出；
- 4、基金申报价格最小变动单位为 0.001 元；
- 5、基金可适用大宗交易的相关规则。

基金上市后，本基金场内份额可直接在上海证券交易所上市交易，场外份额应由基金份额持有人通过申请办理跨系统转托管将基金份额转为场内份额后，方可上市交易。

在不违反法律法规的规定及基金合同的约定、且对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，若上海证券交易所增加交易型开放式指数基金分级业务模式，基金管理人在与基金托管人协商一致后可以（无需召开基金份额持有人大会）增加本基金分级份额，并报中国证监会备案后公告。

### （三）终止上市交易

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

- 1、不再具备本部分第（一）款规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；

- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

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

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市开放式指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议。若届时，基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护投资人合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并或者选取其他合适的指数作为标的指数。

#### **（四）基金份额参考净值的计算与公告**

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，中证指数有限公司在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、场内申购、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、赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

- 2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。
- 3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

#### **（五）其他事项**

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，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十、基金份额的申购与赎回

本基金的基金份额分为场内份额与场外份额两种，分别适用不同的申购赎回办法。

### （一）申购与赎回的场所

#### 1、场内申购赎回

投资者应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。

基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

#### 2、场外申购赎回

对于在场外申购赎回的投资人，应当在基金管理人或其指定的其他销售机构办理本基金的申购和赎回，基金管理人在开始场外申购、赎回业务前公告有关场外申购赎回的具体办法，包括但不限于：适用场外申赎方式的条件、开放日场外申赎的截止时间、业务规则等等。

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，基金管理人可根据市场情况停止办理场外申购赎回业务。在决定停止场外申购赎回业务情况下，基金管理人应采取适当措施对原有场外份额持有人作出妥善安排并提前公告。

#### 3、特殊申购

在基金合同生效后，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，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的深市成份股，本基金联接基金可以采用实物方式或“深市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通的场内申购。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

场内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。

场外投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间见基金管理人届时的相关公告。基金管理人可根据实际情况需要进行调整，具体办理时间以基金管理人的规定为准；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。本基金场外申购赎回的开放时间与场内申购赎回的开放时间存在差异，投资者应关注基金管理

人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。

场外投资人在基金合同约定之外的时间和日期提出申购、赎回等申请，且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

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

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 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 3 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》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金场外申购赎回的开始时间可能与场内申购赎回的开始时间存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回。

## （三）申购与赎回的原则

1、本基金的场内份额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；本基金的场外份额采用金额申购、份额赎回的方式，即申购以金额申请、赎回以份额申请。

2、本基金场内份额的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；本基金场外份额的申购对价、赎回对价为现金。

3、场外份额申购赎回遵循“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

4、场外份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

5、条件许可情况下，本基金场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管，也可跨系统转托管为场内份额，但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

6、场内申购、赎回申请提交后不得撤销；当日的场外申购、赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销。

7、场内申购赎回应遵守《业务规则》的规定；场外申购赎回应遵守基金管理人的相关业务规则。

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

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、场内申购与赎回的程序

###### （1）申购与赎回的申请方式

基金投资者须按申购赎回代理券商的规定，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，其必须有足够的基金份额余额和现金。

###### （2）申购与赎回申请的确认

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，则赎回申请失败。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

###### （3）申购和赎回的清算交收与登记

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

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

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销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，则依据相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

登记机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

## 2、场外申购与赎回的程序

### (1) 申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金管理人规定的程序，在开放日的开放时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须全额交付申购款项，并在规定的截止时间前划到销售机构指定的账户上，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

### (2) 申购和赎回申请的确认

基金管理人以事先规定的截止时间前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日对该交易的有效性进行确认。申购、赎回的确认以基金登记机构的确认结果为准。

### (3) 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定的截止时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金管理人将在接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生暂停赎回或延缓支付赎回款的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### (4) 申购和赎回的注册登记

正常情况下，投资者 T 日申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+1 日起有权申请赎回该部分基金份额，或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管；

基金份额持有人 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续；

在法律法规允许的范围内，登记机构可以对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，基金管理人最迟于开始实施前 2 日在指定媒介上公告。

### (5) 申购和赎回的投资交易

对于 T 日截止时间前收到的有效申购及有效赎回申请，基金管理人将根据轧差之后的净申购金额或净赎回数量，采用算法交易系统，按尽可能贴近收盘价的原则，在 T 日完成相应的证券交易。

## (五) 申购和赎回的数额限制

### 1、场内申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金的最小申购、赎回单位为 200 万份。



当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 2、场外申购和赎回的数额限制

(1) 投资者每次申购的单笔最低金额为人民币肆佰万元整（4,000,000），每次赎回的单笔最低份额为 200 万份。

(2) 投资者可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回不得少于 200 万份（如该账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足 200 万份，则必须一次性赎回该基金全部场外份额）；若某笔赎回将导致投资者在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足 200 万份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

(3) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(4) 上述规定详见基金管理人相关业务规则。基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## （六）申购和赎回的对价、费用

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 2、场内申购和赎回的对价、费用

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

(2) 申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

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

### 3、场外申购和赎回的价格、费用

(1) 申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额计算结果均按四舍五入方法，保留到整数位，申购费用以人民币元为单位，四舍五入保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(2) 赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回相关费用（如有），赎回金额、赎回费用的单位为人民币元，四舍五入保留到小数点两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(3) 投资者在申购或赎回基金份额时，基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平，收取一定的申购费和/或赎回费并归入基金资产，确保覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。申购、赎回费率水平如下：

申购费率	0.05%
赎回费率	0.15%

本基金的申购费由申购人承担，赎回费由赎回人承担，申购费与赎回费均全部归入基金财产。

基金管理人可根据市场情况调整申购费率、赎回费率，并在指定媒介公告后实施。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金的销售费率。

#### (4) 申购份额、赎回金额的计算方式：

##### 1) 申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其计算方法为：

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

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

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} \div T \text{ 日基金份额净值}$$

例：某投资者投资 300 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 5.3846 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 3,000,000 / (1 + 0.05\%) = 2,998,500.75 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 3,000,000 - 2,998,500.75 = 1,499.25 \text{ 元}$$

申购份额=2,998,500.75/5.3846=556,866 份

即：投资者投资 300 万元申购本基金，对应的申购费率为 0.05%，假设申购当日基金份额净值为 5.3846 元，则其可得到 556,866 份基金份额。

## 2) 赎回金额的计算

本基金赎回金额的计算方法为：

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-赎回费用

例：某投资者赎回本基金 100 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.15%，假设赎回当日基金份额净值是 5.3846 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=1,000,000×5.3846=5,384,600 元

赎回费用=5,384,600×0.15%=8,076.90 元

净赎回金额=5,384,600 - 8,076.90=5,376,523.10 元

即：投资者赎回本基金 100 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.15%，假设赎回当日基金份额净值是 5.3846 元，则其可得到的净赎回金额为 5,376,523.10 元。

(5) 由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

## (七) 场内申购赎回清单的内容与格式

### 1、申购、赎回清单的内容

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

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

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

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

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

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

退补现金替代适用于深交所上市的成份股，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。

## 2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于中证 500 指数中的上交所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

其中，“该证券参考价格”为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所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。

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溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

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

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

若现金替代日（T 日）后至 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券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

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

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

其中，“基金份额参考净值（IOPV）”为本基金前一交易日除权除息后的收盘价，“该证券参考价格”为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### 3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票。

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

### 4) 退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证 500 指数中深交所股票。

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

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

### ③替代金额的处理程序

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

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

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

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 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。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

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

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

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

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2' 日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2' 日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

#### 4、预估现金部分相关内容

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

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

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

其中，该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

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

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

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

#### 6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

##### 基本信息

最新公告日期	2017-11-13
基金名称	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
一级市场基金代码	512511

##### 2017 年 11 月 10 日信息内容

现金差额（单位：元）	¥-71,102.17
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	¥2,747,663.83
基金份额净值（单位：元）	¥1.3738

##### 2017 年 11 月 13 日信息内容

预估现金部分（单位：元）	¥-73,028.17
现金替代比例上限	50%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	2,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购、允许赎回

##### 成份股信息内容

股票代码	股票名称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
000006	深振业 A	600	深市退补	10.00%	5,910.00
000012	南玻 A	700	深市退补	10.00%	5,768.00
000021	深科技	500	深市退补	10.00%	5,045.00
000025	特力 A	100	深市退补	10.00%	4,341.00
000027	深圳能源	800	深市退补	10.00%	5,104.00
000028	国药一致	100	深市退补	10.00%	6,522.00
000031	中粮地产	700	深市退补	10.00%	5,600.00
000039	中集集团	500	深市退补	10.00%	10,455.00
000049	德赛电池	100	深市退补	10.00%	5,550.00
000050	深天马 A	500	深市退补	10.00%	12,500.00
000061	农产品	400	深市退补	10.00%	3,252.00
000062	深圳华强	100	深市退补	10.00%	2,495.00



000066	中国长城	1,100	深市退补	10.00%	8,679.00
000078	海王生物	1,000	深市退补	10.00%	6,060.00
000089	深圳机场	700	深市退补	10.00%	6,349.00
000090	天健集团	400	深市退补	10.00%	4,288.00
000099	中信海直	300	深市退补	10.00%	3,135.00
000158	常山北明	400	深市退补	10.00%	3,832.00
000400	许继电气	400	深市退补	10.00%	6,288.00
000401	冀东水泥	400	深市退补	10.00%	5,672.00
000417	合肥百货	300	深市退补	10.00%	2,583.00
000418	小天鹅A	100	深市退补	10.00%	5,920.00
000426	兴业矿业	400	深市退补	10.00%	4,060.00
000488	晨鸣纸业	600	深市退补	10.00%	10,206.00
000501	鄂武商A	200	深市退补	10.00%	3,470.00
000513	丽珠集团	100	深市退补	10.00%	7,180.00
000517	荣安地产	400	深市退补	10.00%	1,660.00
000519	中兵红箭	400	深市退补	10.00%	3,704.00
000528	柳工	500	深市退补	10.00%	4,090.00
000536	华映科技	400	深市退补	10.00%	2,164.00
000541	佛山照明	400	深市退补	10.00%	3,748.00
000543	皖能电力	700	深市退补	10.00%	3,794.00
000547	航天发展	600	深市退补	10.00%	6,498.00
000552	靖远煤电	900	深市退补	10.00%	3,357.00
000563	陕国投A	1,000	深市退补	10.00%	5,120.00
000566	海南海药	500	深市退补	10.00%	6,615.00
000572	海马汽车	700	深市退补	10.00%	3,717.00
000581	威孚高科	300	深市退补	10.00%	7,770.00
000587	金洲慈航	500	深市退补	10.00%	3,330.00
000592	平潭发展	1,000	深市退补	10.00%	5,750.00
000596	古井贡酒	100	深市退补	10.00%	7,346.00
000598	兴蓉环境	1,100	深市退补	10.00%	6,347.00
000600	建投能源	500	深市退补	10.00%	4,665.00
000612	焦作万方	500	深市退补	10.00%	5,335.00
000616	海航投资	700	深市退补	10.00%	2,968.00
000620	新华联	500	深市退补	10.00%	3,230.00
000636	风华高科	500	深市退补	10.00%	5,630.00
000652	泰达股份	700	深市退补	10.00%	3,626.00
000656	金科股份	1,700	深市退补	10.00%	7,956.00
000661	长春高新	100	深市退补	10.00%	18,498.00
000662	天夏智慧	200	深市退补	10.00%	3,306.00
000667	美好置业	1,600	深市退补	10.00%	5,104.00
000669	金鸿控股	200	深市退补	10.00%	3,030.00
000680	山推股份	600	深市退补	10.00%	3,240.00
000681	视觉中国	200	深市退补	10.00%	3,996.00
000685	中山公用	600	深市退补	10.00%	6,402.00
000690	宝新能源	1,000	深市退补	10.00%	7,970.00
000697	炼石有色	300	深市退补	10.00%	7,722.00

000703	恒逸石化	300	深市退补	10.00%	4,644.00
000712	锦龙股份	300	深市退补	10.00%	5,886.00
000726	鲁泰 A	300	深市退补	10.00%	3,342.00
000727	华东科技	1,700	深市退补	10.00%	4,760.00
000729	燕京啤酒	900	深市退补	10.00%	5,580.00
000732	泰禾集团	300	深市退补	10.00%	5,151.00
000758	中色股份	800	深市退补	10.00%	5,512.00
000761	本钢板材	200	深市退补	10.00%	1,098.00
000762	西藏矿业	300	深市退补	10.00%	5,124.00
000766	通化金马	200	深市退补	10.00%	2,694.00
000777	中核科技	200	深市退补	10.00%	3,398.00
000778	新兴铸管	1,300	深市退补	10.00%	7,579.00
000786	北新建材	600	深市退补	10.00%	13,542.00
000806	银河生物	400	深市退补	10.00%	4,304.00
000810	创维数字	300	深市退补	10.00%	3,255.00
000816	智慧农业	700	深市退补	10.00%	2,989.00
000825	太钢不锈	1,400	深市退补	10.00%	7,308.00
000829	天音控股	400	深市退补	10.00%	4,172.00
000830	鲁西化工	700	深市退补	10.00%	9,051.00
000848	承德露露	400	深市退补	10.00%	4,216.00
000860	顺鑫农业	300	深市退补	10.00%	6,078.00
000877	天山股份	400	深市退补	10.00%	4,496.00
000878	云南铜业	500	深市退补	10.00%	6,710.00
000897	津滨发展	800	深市退补	10.00%	3,240.00
000926	福星股份	500	深市退补	10.00%	6,115.00
000930	中粮生化	600	深市退补	10.00%	8,004.00
000937	冀中能源	700	深市退补	10.00%	4,270.00
000939	凯迪生态	1,000	深市退补	10.00%	4,870.00
000960	锡业股份	500	深市退补	10.00%	7,010.00
000969	安泰科技	400	深市退补	10.00%	3,956.00
000970	中科三环	500	深市退补	10.00%	7,850.00
000975	银泰资源	400	深市退补	10.00%	5,308.00
000979	中弘股份	3,200	深市退补	10.00%	6,208.00
000988	华工科技	400	深市退补	10.00%	7,696.00
000997	新大陆	400	深市退补	10.00%	8,552.00
000998	隆平高科	500	深市退补	10.00%	12,920.00
000999	华润三九	200	深市退补	10.00%	5,652.00
001696	宗申动力	400	深市退补	10.00%	2,980.00
002001	新和成	300	深市退补	10.00%	7,764.00
002002	鸿达兴业	700	深市退补	10.00%	5,201.00
002004	华邦健康	900	深市退补	10.00%	6,651.00
002005	德豪润达	700	深市退补	10.00%	3,444.00
002011	盾安环境	300	深市退补	10.00%	2,928.00
002013	中航机电	600	深市退补	10.00%	6,594.00
002018	华信国际	600	深市退补	10.00%	4,878.00
002019	亿帆医药	400	深市退补	10.00%	10,204.00

002022	科华生物	300	深市退补	10.00%	4,929.00
002028	思源电气	300	深市退补	10.00%	5,418.00
002030	达安基因	300	深市退补	10.00%	5,688.00
002038	双鹭药业	300	深市退补	10.00%	10,356.00
002041	登海种业	200	深市退补	10.00%	2,506.00
002048	宁波华翔	300	深市退补	10.00%	7,944.00
002050	三花智控	500	深市退补	10.00%	9,500.00
002051	中工国际	300	深市退补	10.00%	6,114.00
002056	横店东磁	500	深市退补	10.00%	5,660.00
002063	远光软件	300	深市退补	10.00%	3,357.00
002064	华峰氨纶	700	深市退补	10.00%	3,514.00
002073	软控股份	400	深市退补	10.00%	3,448.00
002078	太阳纸业	1,000	深市退补	10.00%	8,990.00
002092	中泰化学	800	深市退补	10.00%	11,016.00
002093	国脉科技	300	深市退补	10.00%	2,829.00
002106	莱宝高科	400	深市退补	10.00%	4,020.00
002118	紫鑫药业	300	深市退补	10.00%	2,307.00
002120	韵达股份	100	深市退补	10.00%	4,691.00
002122	天马股份	500	深市退补	10.00%	5,125.00
002123	梦网集团	300	深市退补	10.00%	3,369.00
002127	南极电商	500	深市退补	10.00%	7,675.00
002128	露天煤业	400	深市退补	10.00%	4,568.00
002147	新光圆成	200	深市退补	10.00%	2,560.00
002155	湖南黄金	500	深市退补	10.00%	4,600.00
002176	江特电机	700	深市退补	10.00%	9,443.00
002179	中航光电	300	深市退补	10.00%	10,956.00
002190	成飞集成	100	深市退补	10.00%	2,488.00
002191	劲嘉股份	600	深市退补	10.00%	6,282.00
002194	武汉凡谷	100	深市退补	10.00%	1,363.00
002217	合力泰	800	深市退补	10.00%	9,712.00
002221	东华能源	500	深市退补	10.00%	6,095.00
002223	鱼跃医疗	300	深市退补	10.00%	6,564.00
002233	塔牌集团	200	深市退补	10.00%	2,432.00
002242	九阳股份	200	深市退补	10.00%	3,818.00
002244	滨江集团	1,000	深市退补	10.00%	6,840.00
002249	大洋电机	600	深市退补	10.00%	4,662.00
002250	联化科技	400	深市退补	10.00%	5,096.00
002251	步步高	200	深市退补	10.00%	2,938.00
002254	泰和新材	300	深市退补	10.00%	3,849.00
002261	拓维信息	400	深市退补	10.00%	3,436.00
002266	浙富控股	1,000	深市退补	10.00%	4,610.00
002268	卫士通	300	深市退补	10.00%	7,557.00
002269	美邦服饰	800	深市退补	10.00%	2,816.00
002271	东方雨虹	300	深市退补	10.00%	11,160.00
002273	水晶光电	300	深市退补	10.00%	9,153.00
002276	万马股份	400	深市退补	10.00%	4,152.00

002277	友阿股份	500	深市退补	10.00%	3,265.00
002281	光迅科技	200	深市退补	10.00%	5,880.00
002285	世联行	500	深市退补	10.00%	6,775.00
002308	威创股份	300	深市退补	10.00%	3,972.00
002309	中利集团	200	深市退补	10.00%	2,820.00
002311	海大集团	400	深市退补	10.00%	8,052.00
002315	焦点科技	100	深市退补	10.00%	2,537.00
002317	众生药业	300	深市退补	10.00%	3,849.00
002325	洪涛股份	600	深市退补	10.00%	3,438.00
002332	仙琚制药	400	深市退补	10.00%	3,916.00
002340	格林美	1,700	深市退补	10.00%	13,634.00
002342	巨力索具	400	深市退补	10.00%	2,932.00
002344	海宁皮城	300	深市退补	10.00%	2,379.00
002345	潮宏基	300	深市退补	10.00%	3,540.00
002353	杰瑞股份	300	深市退补	10.00%	4,815.00
002354	天神娱乐	300	深市退补	10.00%	6,054.00
002358	森源电气	200	深市退补	10.00%	3,170.00
002366	台海核电	300	深市退补	10.00%	9,192.00
002368	太极股份	200	深市退补	10.00%	5,830.00
002371	北方华创	100	深市退补	10.00%	4,205.00
002373	千方科技	400	深市退补	10.00%	5,564.00
002375	亚厦股份	500	深市退补	10.00%	4,320.00
002384	东山精密	300	深市退补	10.00%	10,215.00
002390	信邦制药	700	深市退补	10.00%	6,209.00
002392	北京利尔	400	深市退补	10.00%	2,408.00
002396	星网锐捷	200	深市退补	10.00%	5,090.00
002400	省广股份	800	深市退补	10.00%	4,752.00
002405	四维图新	600	深市退补	10.00%	17,700.00
002407	多氟多	400	深市退补	10.00%	9,276.00
002408	齐翔腾达	600	深市退补	10.00%	7,680.00
002410	广联达	400	深市退补	10.00%	8,836.00
002414	高德红外	100	深市退补	10.00%	1,863.00
002416	爱施德	200	深市退补	10.00%	2,142.00
002422	科伦药业	500	深市退补	10.00%	11,450.00
002428	云南锗业	300	深市退补	10.00%	3,120.00
002431	棕榈股份	600	深市退补	10.00%	5,694.00
002437	誉衡药业	600	深市退补	10.00%	4,170.00
002439	启明星辰	300	深市退补	10.00%	7,590.00
002440	闰土股份	300	深市退补	10.00%	5,217.00
002444	巨星科技	300	深市退补	10.00%	5,025.00
002460	赣锋锂业	300	深市退补	10.00%	25,554.00
002463	沪电股份	700	深市退补	10.00%	4,081.00
002468	申通快递	200	深市退补	10.00%	5,218.00
002477	雏鹰农牧	1,200	深市退补	10.00%	5,184.00
002479	富春环保	300	深市退补	10.00%	3,225.00
002482	广田集团	400	深市退补	10.00%	3,432.00

002489	浙江永强	700	深市退补	10.00%	4,641.00
002491	通鼎互联	500	深市退补	10.00%	6,460.00
002503	搜于特	600	深市退补	10.00%	3,816.00
002505	大康农业	1,000	深市退补	10.00%	2,930.00
002512	达华智能	300	深市退补	10.00%	6,030.00
002517	恺英网络	300	深市退补	10.00%	6,849.00
002544	杰赛科技	200	深市退补	10.00%	3,920.00
002551	尚荣医疗	200	深市退补	10.00%	2,000.00
002572	索菲亚	400	深市退补	10.00%	15,300.00
002573	清新环境	400	深市退补	10.00%	8,732.00
002583	海能达	400	深市退补	10.00%	8,920.00
002588	史丹利	400	深市退补	10.00%	2,888.00
002589	瑞康医药	300	深市退补	10.00%	4,380.00
002601	龙蟠佰利	400	深市退补	10.00%	6,580.00
002603	以岭药业	300	深市退补	10.00%	5,319.00
002635	安洁科技	200	深市退补	10.00%	8,036.00
002640	跨境通	300	深市退补	10.00%	6,174.00
002642	荣之联	200	深市退补	10.00%	3,312.00
002646	青青稞酒	100	深市退补	10.00%	1,750.00
002657	中科金财	200	深市退补	10.00%	5,356.00
002663	普邦股份	600	深市退补	10.00%	3,312.00
002665	首航节能	800	深市退补	10.00%	5,936.00
002670	国盛金控	300	深市退补	10.00%	6,564.00
002672	东江环保	300	深市退补	10.00%	4,698.00
002681	奋达科技	300	深市退补	10.00%	3,765.00
002690	美亚光电	200	深市退补	10.00%	3,808.00
002699	美盛文化	200	深市退补	10.00%	3,714.00
002701	奥瑞金	900	深市退补	10.00%	5,913.00
002707	众信旅游	300	深市退补	10.00%	3,417.00
002709	天赐材料	100	深市退补	10.00%	4,865.00
002727	一心堂	200	深市退补	10.00%	4,178.00
002807	江阴银行	100	深市退补	10.00%	872.00
002815	崇达技术	100	深市退补	10.00%	3,501.00
002818	富森美	100	深市退补	10.00%	3,628.00
300001	特锐德	300	深市退补	10.00%	4,773.00
300002	神州泰岳	900	深市退补	10.00%	6,354.00
300010	立思辰	300	深市退补	10.00%	3,537.00
300026	红日药业	1,100	深市退补	10.00%	4,818.00
300032	金龙机电	200	深市退补	10.00%	2,830.00
300039	上海凯宝	400	深市退补	10.00%	2,812.00
300043	星辉娱乐	400	深市退补	10.00%	2,928.00
300055	万邦达	400	深市退补	10.00%	7,988.00
300058	蓝色光标	800	深市退补	10.00%	5,688.00
300088	长信科技	1,200	深市退补	10.00%	12,336.00
300113	顺网科技	300	深市退补	10.00%	5,592.00
300115	长盈精密	300	深市退补	10.00%	9,042.00

300116	坚瑞沃能	500	深市退补	10.00%	4,915.00
300122	智飞生物	300	深市退补	10.00%	8,559.00
300134	大富科技	200	深市退补	10.00%	2,480.00
300136	信维通信	500	深市退补	10.00%	27,630.00
300146	汤臣倍健	500	深市退补	10.00%	7,130.00
300147	香雪制药	300	深市退补	10.00%	2,829.00
300156	神雾环保	400	深市退补	10.00%	9,664.00
300159	新研股份	500	深市退补	10.00%	5,880.00
300166	东方国信	400	深市退补	10.00%	5,380.00
300199	翰宇药业	300	深市退补	10.00%	4,647.00
300202	聚龙股份	200	深市退补	10.00%	3,716.00
300244	迪安诊断	200	深市退补	10.00%	5,616.00
300253	卫宁健康	700	深市退补	10.00%	5,194.00
300257	开山股份	200	深市退补	10.00%	3,568.00
300266	兴源环境	300	深市退补	10.00%	7,950.00
300273	和佳股份	300	深市退补	10.00%	3,096.00
300274	阳光电源	400	深市退补	10.00%	8,328.00
300287	飞利信	500	深市退补	10.00%	4,160.00
300291	华录百纳	300	深市退补	10.00%	4,056.00
300296	利亚德	500	深市退补	10.00%	10,940.00
300297	蓝盾股份	300	深市退补	10.00%	3,201.00
300324	旋极信息	400	深市退补	10.00%	5,908.00
300376	易事特	400	深市退补	10.00%	3,476.00
300383	光环新网	600	深市退补	10.00%	7,914.00
600006	东风汽车	500	允许	10.00%	
600017	日照港	1,200	允许	10.00%	
600022	山东钢铁	4,200	允许	10.00%	
600026	中远海能	900	允许	10.00%	
600039	四川路桥	1,100	允许	10.00%	
600053	九鼎投资	100	允许	10.00%	
600056	中国医药	300	允许	10.00%	
600058	五矿发展	300	允许	10.00%	
600059	古越龙山	300	允许	10.00%	
600062	华润双鹤	300	允许	10.00%	
600064	南京高科	300	允许	10.00%	
600073	上海梅林	400	允许	10.00%	
600079	人福医药	600	允许	10.00%	
600086	东方金钰	400	允许	10.00%	
600094	大名城	700	允许	10.00%	
600098	广州发展	500	允许	10.00%	
600108	亚盛集团	1,000	允许	10.00%	
600120	浙江东方	200	允许	10.00%	
600122	宏图高科	600	允许	10.00%	
600125	铁龙物流	600	允许	10.00%	
600126	杭钢股份	200	允许	10.00%	
600138	中青旅	400	允许	10.00%	

600141	兴发集团	200	允许	10.00%	
600143	金发科技	1,000	允许	10.00%	
600151	航天机电	500	允许	10.00%	
600158	中体产业	400	允许	10.00%	
600160	巨化股份	500	允许	10.00%	
600161	天坛生物	200	允许	10.00%	
600166	福田汽车	3,000	允许	10.00%	
600169	太原重工	1,100	允许	10.00%	
600171	上海贝岭	300	允许	10.00%	
600176	中国巨石	1,100	允许	10.00%	
600183	生益科技	500	允许	10.00%	
600184	光电股份	100	允许	10.00%	
600187	国中水务	800	允许	10.00%	
600195	中牧股份	100	允许	10.00%	
600198	大唐电信	400	允许	10.00%	
600200	江苏吴中	400	允许	10.00%	
600201	生物股份	500	允许	10.00%	
600216	浙江医药	400	允许	10.00%	
600219	南山铝业	3,500	允许	10.00%	
600220	江苏阳光	900	允许	10.00%	
600240	华业资本	700	允许	10.00%	
600251	冠农股份	300	允许	10.00%	
600259	广晟有色	100	允许	10.00%	
600260	凯乐科技	300	允许	10.00%	
600266	北京城建	600	允许	10.00%	
600267	海正药业	400	允许	10.00%	
600270	外运发展	200	允许	10.00%	
600277	亿利洁能	500	允许	10.00%	
600280	中央商场	400	允许	10.00%	
600282	南钢股份	1,400	允许	10.00%	
600284	浦东建设	400	允许	10.00%	
600289	亿阳信通	300	允许	10.00%	
600291	西水股份	400	允许	10.00%	
600292	远达环保	200	允许	10.00%	
600298	安琪酵母	300	允许	10.00%	
600300	维维股份	700	允许	10.00%	
600307	酒钢宏兴	2,000	允许	10.00%	
600312	平高电气	400	允许	10.00%	
600315	上海家化	300	允许	10.00%	
600316	洪都航空	300	允许	10.00%	
600325	华发股份	1,100	允许	10.00%	
600329	中新药业	200	允许	10.00%	
600335	国机汽车	200	允许	10.00%	
600338	西藏珠峰	100	允许	10.00%	
600348	阳泉煤业	800	允许	10.00%	
600366	宁波韵升	200	允许	10.00%	

600380	健康元	500	允许	10.00%	
600388	龙净环保	500	允许	10.00%	
600392	盛和资源	500	允许	10.00%	
600395	盘江股份	400	允许	10.00%	
600409	三友化工	700	允许	10.00%	
600410	华胜天成	600	允许	10.00%	
600416	湘电股份	400	允许	10.00%	
600418	江淮汽车	600	允许	10.00%	
600422	昆药集团	400	允许	10.00%	
600426	华鲁恒升	700	允许	10.00%	
600428	中远海特	500	允许	10.00%	
600435	北方导航	600	允许	10.00%	
600458	时代新材	300	允许	10.00%	
600460	士兰微	500	允许	10.00%	
600466	蓝光发展	500	允许	10.00%	
600478	科力远	600	允许	10.00%	
600481	双良节能	500	允许	10.00%	
600487	亨通光电	600	允许	10.00%	
600496	精工钢构	800	允许	10.00%	
600499	科达洁能	700	允许	10.00%	
600500	中化国际	700	允许	10.00%	
600503	华丽家族	1,000	允许	10.00%	
600511	国药股份	200	允许	10.00%	
600516	方大炭素	700	允许	10.00%	
600517	置信电气	400	允许	10.00%	
600521	华海药业	400	允许	10.00%	
600525	长园集团	800	允许	10.00%	
600528	中铁工业	600	允许	10.00%	
600536	中国软件	200	允许	10.00%	
600537	亿晶光电	500	允许	10.00%	
600545	新疆城建	400	允许	10.00%	
600551	时代出版	100	允许	10.00%	
600557	康缘药业	300	允许	10.00%	
600563	法拉电子	100	允许	10.00%	
600565	迪马股份	900	允许	10.00%	
600566	济川药业	200	允许	10.00%	
600572	康恩贝	800	允许	10.00%	
600580	卧龙电气	400	允许	10.00%	
600582	天地科技	1,000	允许	10.00%	
600584	长电科技	600	允许	10.00%	
600586	金晶科技	700	允许	10.00%	
600587	新华医疗	200	允许	10.00%	
600594	益佰制药	400	允许	10.00%	
600596	新安股份	300	允许	10.00%	
600597	光明乳业	400	允许	10.00%	
600600	青岛啤酒	200	允许	10.00%	



600611	大众交通	800	允许	10.00%	
600614	鹏起科技	700	允许	10.00%	
600618	氯碱化工	100	允许	10.00%	
600628	新世界	200	允许	10.00%	
600633	浙数文化	300	允许	10.00%	
600635	大众公用	1,200	允许	10.00%	
600639	浦东金桥	200	允许	10.00%	
600640	号百控股	200	允许	10.00%	
600642	申能股份	1,700	允许	10.00%	
600643	爱建集团	900	允许	10.00%	
600645	中源协和	200	允许	10.00%	
600648	外高桥	200	允许	10.00%	
600651	飞乐音响	400	允许	10.00%	
600655	豫园股份	600	允许	10.00%	
600657	信达地产	500	允许	10.00%	
600664	哈药股份	1,000	允许	10.00%	
600673	东阳光科	1,100	允许	10.00%	
600687	刚泰控股	400	允许	10.00%	
600694	大商股份	100	允许	10.00%	
600699	均胜电子	200	允许	10.00%	
600717	天津港	500	允许	10.00%	
600720	祁连山	400	允许	10.00%	
600729	重庆百货	200	允许	10.00%	
600736	苏州高新	500	允许	10.00%	
600743	华远地产	600	允许	10.00%	
600748	上实发展	400	允许	10.00%	
600750	江中药业	100	允许	10.00%	
600751	天海投资	800	允许	10.00%	
600754	锦江股份	100	允许	10.00%	
600755	厦门国贸	800	允许	10.00%	
600757	长江传媒	400	允许	10.00%	
600759	洲际油气	700	允许	10.00%	
600765	中航重机	300	允许	10.00%	
600770	综艺股份	500	允许	10.00%	
600773	西藏城投	300	允许	10.00%	
600776	东方通信	300	允许	10.00%	
600787	中储股份	700	允许	10.00%	
600790	轻纺城	500	允许	10.00%	
600801	华新水泥	300	允许	10.00%	
600805	悦达投资	400	允许	10.00%	
600808	马钢股份	1,900	允许	10.00%	
600809	山西汾酒	200	允许	10.00%	
600811	东方集团	1,200	允许	10.00%	
600826	兰生股份	100	允许	10.00%	
600831	广电网络	200	允许	10.00%	
600835	上海机电	200	允许	10.00%	

600839	四川长虹	2,300	允许	10.00%	
600848	上海临港	200	允许	10.00%	
600859	王府井	200	允许	10.00%	
600862	中航高科	300	允许	10.00%	
600863	内蒙华电	1,800	允许	10.00%	
600869	智慧能源	400	允许	10.00%	
600872	中炬高新	400	允许	10.00%	
600874	创业环保	300	允许	10.00%	
600879	航天电子	1,000	允许	10.00%	
600880	博瑞传播	500	允许	10.00%	
600881	亚泰集团	1,000	允许	10.00%	
600884	杉杉股份	400	允许	10.00%	
600894	广日股份	300	允许	10.00%	
600917	重庆燃气	100	允许	10.00%	
600936	广西广电	200	允许	10.00%	
600967	内蒙一机	400	允许	10.00%	
600970	中材国际	700	允许	10.00%	
600971	恒源煤电	300	允许	10.00%	
600978	宜华生活	800	允许	10.00%	
600993	马应龙	200	允许	10.00%	
600996	贵广网络	200	允许	10.00%	
601000	唐山港	1,400	允许	10.00%	
601001	大同煤业	500	允许	10.00%	
601002	晋亿实业	300	允许	10.00%	
601012	隆基股份	800	允许	10.00%	
601016	节能风电	1,100	允许	10.00%	
601020	华钰矿业	100	允许	10.00%	
601168	西部矿业	1,200	允许	10.00%	
601231	环旭电子	400	允许	10.00%	
601233	桐昆股份	200	允许	10.00%	
601311	骆驼股份	300	允许	10.00%	
601678	滨化股份	600	允许	10.00%	
601689	拓普集团	100	允许	10.00%	
601699	潞安环能	800	允许	10.00%	
601717	郑煤机	600	允许	10.00%	
601777	力帆股份	400	允许	10.00%	
601811	新华文轩	100	允许	10.00%	
601880	大连港	2,000	允许	10.00%	
601886	江河集团	300	允许	10.00%	
601928	凤凰传媒	500	允许	10.00%	
601929	吉视传媒	1,400	允许	10.00%	
603000	人民网	400	允许	10.00%	
603001	奥康国际	100	允许	10.00%	
603005	晶方科技	100	允许	10.00%	
603019	中科曙光	200	允许	10.00%	
603025	大豪科技	100	必须		3,447.00

603077	和邦生物	2,200	允许	10.00%	
603169	兰石重装	200	允许	10.00%	
603188	亚邦股份	200	允许	10.00%	
603198	迎驾贡酒	200	允许	10.00%	
603228	景旺电子	100	必须		5,762.00
603328	依顿电子	100	允许	10.00%	
603355	莱克电气	100	允许	10.00%	
603369	今世缘	200	允许	10.00%	
603377	东方时尚	100	允许	10.00%	
603444	吉比特	100	必须		23,894.00
603515	欧普照明	100	必须		4,916.00
603528	多伦科技	100	允许	10.00%	
603556	海兴电力	100	允许	10.00%	
603567	珍宝岛	100	允许	10.00%	
603568	伟明环保	100	允许	10.00%	
603569	长久物流	100	必须		3,027.00
603589	口子窖	200	允许	10.00%	
603658	安图生物	100	必须		5,457.00
603698	航天工程	100	允许	10.00%	
603766	隆鑫通用	700	允许	10.00%	
603799	华友钴业	200	允许	10.00%	
603806	福斯特	100	允许	10.00%	
603816	顾家家居	100	允许	10.00%	
603866	桃李面包	100	必须		4,375.00
603868	飞科电器	100	必须		8,011.00
603877	太平鸟	100	必须		2,771.00
603883	老百姓	100	允许	10.00%	
603888	新华网	100	允许	10.00%	

## （八）场外巨额赎回的情形及处理方式

### 1、场外巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(场外赎回申请份额总数扣除场外申购申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了场外巨额赎回。

### 2、场外巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的场外赎回申请有困难或认为因支付

投资人的场外赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余场外赎回申请延期办理。对于当日的场外赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占场外赎回申请总量的比例，确定当日受理的场外赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交场外赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分场外赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日、与下一开放日场外赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交场外赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理，部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 若本基金发生场外巨额赎回且单个基金份额持有人的场外赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的场外赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的场外赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的场外赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余的场外未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请场外赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

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

### 3、场外巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## （九）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（基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内和场外两种申购方式，也可以只拒绝或暂停其中一种方式）：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

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

7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单。

9、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、上海证券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。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第除第 4 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项（基金管理人可同时对场内和场外两种赎回方式实施暂停或延缓支付赎回款项，也可以只针对其中一种方式）：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户

申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。

#### **(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

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

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### **(十二) 集合申购与其他服务**

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

在条件允许时，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的至少三个工作日予以公告。

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

#### **(十三) 基金的非交易过户、冻结及解冻**

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

#### **(十四) 基金的转托管**

本基金的转托管包括场外份额的系统内转托管及场内外份额的跨系统转托管。

条件许可情况下，在基金管理人制定并发布有关规则后，本基金场外份额可跨系统转托管为场内份额，并进行场内赎回、上市交易。但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

#### **(十五) 其他**

基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，应在新的申购赎回安排实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。



## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

### （二）投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、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）。

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

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

### （三）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它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。

本基金投资股指期货等衍生金融工具时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，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。

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策



略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、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。

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### **（四）标的指数**

本基金的标的指数为中证 500 指数。

中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体状况。

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

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

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

#### **（五）业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

#### **（六）风险收益特征**

本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，

其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

### （七）投资禁止行为与限制

#### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （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）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如法律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；基金管理人应提前三个交易日公告，此调整无需召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （5）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%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）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；
- （10）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；

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

(12) 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%；

(13) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

(15) 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；

(16) 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%；

(17) 每个交易日日终在扣除股指期货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；

(18) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(19) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(20) 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；

(21) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

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

2) 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) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

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规定的，基金管理人不得新增出借业务；

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

(23) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（9）、（19）、（20）、（21）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如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。

3、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。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。

#### （八）基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### （九）基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2024 年 03 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	541,136,329.19	95.24
	其中：股票	541,136,329.19	95.24
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	8,000.14	0.00
	其中：债券	8,000.14	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	23,967,813.22	4.22
8	其他资产	3,082,830.79	0.54
9	合计	568,194,973.34	100.00

注：1. 上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

2. 报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 21,166,442.00 元，占本基金期末资产净值的 3.73%。其中，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 2,927,074.00 元。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,749,898.75	0.66
B	采矿业	25,982,117.48	4.58
C	制造业	334,648,128.42	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,894,669.43	3.50
E	建筑业	5,097,487.10	0.90
F	批发和零售业	13,399,115.51	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	11,018,147.75	1.94
H	住宿和餐饮业	832,784.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,719,659.27	6.82
J	金融业	50,955,539.30	8.98
K	房地产业	6,174,914.37	1.09
L	租赁和商务服务业	8,547,630.34	1.51
M	科学研究和技术服务业	4,466,200.56	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	2,491,816.07	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,105,070.00	0.19
Q	卫生和社会工作	3,505,813.56	0.62
R	文化、体育和娱乐业	8,457,738.19	1.49
S	综合	1,383,282.30	0.24

合计	540,430,012.40	95.19
----	----------------	-------

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	657,785.00	0.12
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	7,942.20	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,460.82	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,097.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	15,750.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	9,280.96	0.00
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	706,316.79	0.12

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

## 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	61,900	4,147,300.00	0.73
2	300394	天孚通信	24,100	3,645,607.00	0.64
3	002463	沪电股份	115,900	3,497,862.00	0.62
4	002028	思源电气	53,716	3,204,159.40	0.56
5	601168	西部矿业	165,203	3,186,765.87	0.56
6	601058	赛轮轮胎	216,400	3,176,752.00	0.56

7	002422	科伦药业	102,500	3,131,375.00	0.55
8	000975	银泰黄金	168,540	3,048,888.60	0.54
9	000988	华工科技	87,155	2,945,839.00	0.52
10	300418	昆仑万维	73,807	2,941,208.95	0.52

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301589	诺瓦星云	631	219,259.88	0.04
2	301587	中瑞股份	3,056	66,406.88	0.01
3	001389	广合科技	2,219	38,677.17	0.01
4	301526	国际复材	8,807	35,756.42	0.01
5	688709	成都华微	979	18,992.60	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	8,000.14	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.14	0.00

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113683	伟 24 转债	80	8,000.14	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2406	中证 500 股指期货 2406	24	24,988,800.00	-838,120.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-838,120.00
股指期货投资本期收益(元)					965,873.47
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-601,000.00

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

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

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

11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,060,814.81
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	22,015.98
7	其他	-



8	合计	3,082,830.79
---	----	--------------

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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	002422	科伦药业	549,900.00	0.10	转融通证券出借
2	000988	华工科技	540,800.00	0.10	转融通证券出借
3	601058	赛轮轮胎	322,960.00	0.06	转融通证券出借
4	300394	天孚通信	302,540.00	0.05	转融通证券出借
5	002463	沪电股份	105,630.00	0.02	转融通证券出借
6	300502	新易盛	67,000.00	0.01	转融通证券出借

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	219,259.88	0.04	新股锁定期内
2	301587	中瑞股份	66,406.88	0.01	新股未上市
3	001389	广合科技	34,807.71	0.01	新股未上市
3	001389	广合科技	3,869.46	0.00	新股锁定期内
4	301526	国际复材	35,756.42	0.01	新股锁定期内
5	688709	成都华微	18,992.60	0.00	新股锁定期内

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

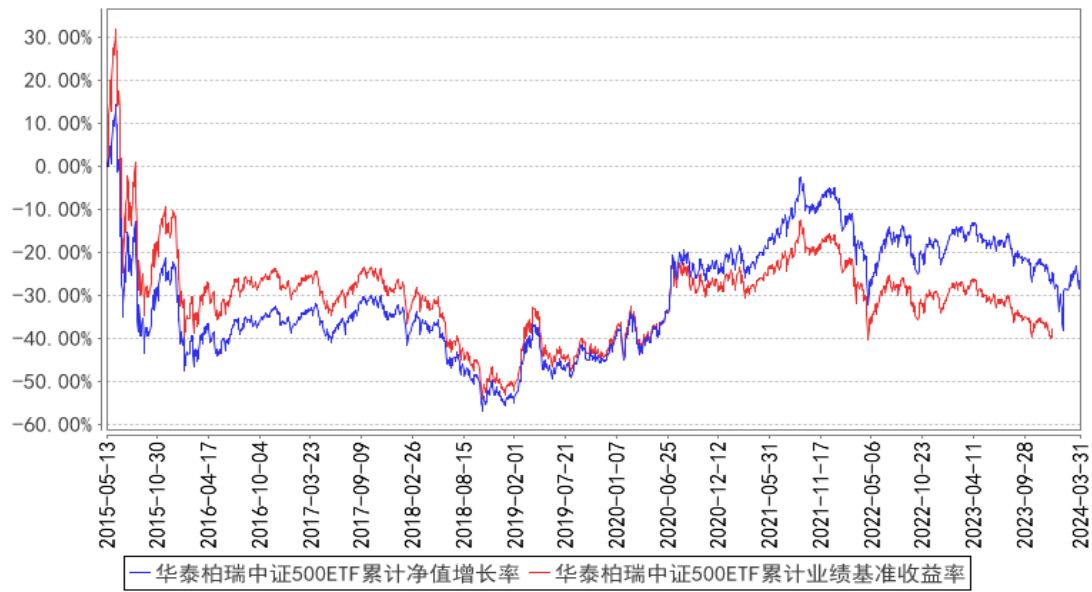
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2024 年 03 月 31 日。

### 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015.05.13-2015.12.31	-24.47%	3.18%	-12.90%	3.26%	-11.57%	-0.08%
2016.01.01-2016.12.31	-15.93%	1.88%	-17.78%	1.90%	1.85%	-0.02%
2017.01.01-2017.12.31	3.50%	0.92%	-0.20%	0.93%	3.70%	-0.01%
2018.01.01-2018.12.31	-31.70%	1.50%	-33.32%	1.51%	1.62%	-0.01%
2019.01.01-2019.12.31	31.48%	1.45%	26.38%	1.47%	5.10%	-0.02%
2020.01.01-2020.12.31	31.00%	1.60%	20.87%	1.62%	10.13%	-0.02%
2021.01.01-2021.12.31	22.80%	0.97%	15.58%	0.97%	7.22%	0.00%
2022.01.01-2022.12.31	-17.17%	1.37%	-20.31%	1.38%	3.14%	-0.01%
2023.01.01-2023.12.31	-4.14%	0.82%	-7.42%	0.82%	3.28%	0.00%
2024.01.01-2024.03.31	-2.47%	1.97%	-2.64%	1.98%	0.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-26.48%	1.58%	-39.56%	1.60%	13.08%	-0.02%

### 2、图示自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 5 月 13 日至 2024 年 3 月 31 日。

### 十三、基金的财产

#### （一）基金资产总值

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

#### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

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

#### （四）基金财产的保管及处分

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。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）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、权证等），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）交易所上市的固定收益类有价证券，区分如下情况处理：对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，使用估值技术或选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，使用估值技术或选取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。对在交易所市场上市交易的可转换债券，使用最近交易日的市价（收盘价）作为估值全价；

（3）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。交易所上市的资产支持证券，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。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确

定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或者两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8、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。

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，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### **（四）估值程序**

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

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### **（五）估值错误的处理**

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(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。

**(六) 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、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

4、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

**(七) 基金净值的确认**

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

**(八) 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 8 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，或证券、期货交易所、存款银行发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更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消除或减轻由此造成的影响。



## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金收益分配原则

1、本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金方式；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的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，方可对超额收益进行分配；

4、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还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5、基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%；

6、基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配；

7、基金收益分配每年至多 4 次；

8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。证券交易所或基金登记机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。

### （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。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算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价与基金份额折算日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

截至收益评价日基金超过标的指数的超额收益=（基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率）×收益评价日发行在外的基金份额总额×基金份额折算日基金份额净值。

2、每基金份额的应分配收益为上述确定的基金超额收益数额除以收益评价日发行在外的基金份额总额，保留小数点后 3 位，第 4 位舍去。

### （三）收益分配方案

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

#### **（四）收益分配方案的确定、公告与实施**

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

#### **（五）收益分配中发生的费用**

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十六、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、指数许可使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的投资标的的交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

本基金的指数许可使用费即指数许可使用基点费，收取标准为基金资产净值的 0.03%。在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.03%的年费率计提。计算方法（“计费公式”）如下：

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

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

当季日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数）大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限为每季人民币叁万伍仟（3.5 万）元，当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

若存在非完整季度（如基金合同生效日所在季度或单一协议终止日所在季度），指数许可使用基点费为下述两项金额中的较高者：

（a）根据计费公式所计算的许可使用基点费

（b）下限金额/当季天数×基金当季存续天数

指数使用费每日计算，逐日累计至每季度末，按季支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

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

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

#### **（四）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### **（五）基金管理费和基金托管费的调整**

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率和基金托管费率，无需召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过，但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

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

## 十八、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》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时, 本基金从其最新规定。

### (二) 信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内, 将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)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、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字; 除特别说明外, 货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

- 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

(1) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系, 明确基金份额持有人大会

召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(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指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(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，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请在中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒介上登载基金合同生效公告。

## 4、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并至少提前 3 个工作日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

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，基金管理人将在 3 个工作日内将基金份额折算结果公告登载于指定媒介上。

## 5、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 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

## 6、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在



指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

#### 7、基金份额申购、赎回对价

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

#### 8、申购、赎回清单

在开始办理基金份额场内申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过基金销售机构网站或营业网点以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

#### 9、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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

本基金将在基金定期报告相应部分披露场外份额变动、场外申赎引起的证券交易费用及收取的场外申赎费用情况。

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

本基金持续运作过程中，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。

#### 10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定

报刊和指定网站上。

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

- 1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2) 《基金合同》终止、基金清算、基金终止上市交易；
- 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) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，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、指数许可使用费、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) 本基金发生场外巨额赎回并延期办理；
- 19) 本基金连续发生场外巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21) 本基金推出新业务或服务；

- 22) 基金交易停牌或复牌;
- 23) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;
- 24) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 11、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和基金上市交易的证券交易所。

#### 12、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。

#### 13、参与转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与转融通证券出借业务的,基金管理人应当在基金定期报告等文件中披露基金参与出借业务的情况,并就报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### 14、清算报告

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

#### 15、中国证监会规定的其他信息

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,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。

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

### (六) 信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说

说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

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

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。

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。

#### **（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、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### **（八）暂停或延迟披露基金信息的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

#### **（九）本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准**

## 十九、基金的风险揭示

投资于本基金的主要风险包括：

### （一）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。

### （二）标的指数波动的风险

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

### （三）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

3、成份股派发现金红利将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

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

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

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

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

#### （四）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### （五）成份股停牌的风险

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

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平；

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

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

#### （六）标的指数变更的风险

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

#### （七）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，并召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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

响投资收益。

#### **(八) 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。

#### **(九) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险**

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

#### **(十) 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。

#### **(十一) 投资者申购失败的风险**

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

#### **(十二) 投资者赎回失败的风险**

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

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

#### **(十三) 退补现金替代方式的风险**

本基金在申购赎回环节新增了“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方

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

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

#### **（十四）基金份额赎回对价的变现风险**

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

#### **（十五）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（包括但不限于技术故障、资格丧失、额度限制等原因），导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

2、登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来交易方式调整的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

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

#### **（十六）管理风险与操作风险**

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。



### （十七）技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错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、证券交易所、登记机构及销售代理机构等。

### （十八）资产支持证券的投资风险

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险、提前偿付风险等风险。本基金将结合定量分析和定性分析的方法，在预期风险可控的前提下，谨慎配置相对风险较低、投资价值较高的资产支持证券。

### （十九）基金投资科创板风险

基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

#### 1、退市风险

（1）科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；

（2）退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；

（3）执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；

（4）不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

#### 2、市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术产业和战略新兴产业，大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，股票投资市场风险加大。

科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

#### 3、流动性风险

科创板投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，整体流动性可能相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### 4、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### 5、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板股票也会带来政策影响。

### **（二十）投资于存托凭证的风险**

本基金的投资范围包括存托凭证，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，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与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。

### **（二十一）不可抗力**

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，并自决议生效后2日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行适当程序后，基金合同应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

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

#### **(六) 基金财产清算的公告**

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

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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) 依法募集基金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

(10) 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；

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

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 依法募集基金，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、申购和赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定, 按有关规定计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回的对价, 编制申购赎回清单;
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;
- (11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;
- (12) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不向他人泄露;
- (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、足额支付赎回对价或者赎回款项;
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出, 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存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；

(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。

3、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，有权呈报中国证监会，并可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、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。

4、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、证券账户和投资所需的其他账户，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；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

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

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；



- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金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。

每份基金份额具有同等的合法权益。但由于证券市场波动、基金管理人为场外投资者买卖证券时机及申购赎回途径不同等原因，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，可能与场内申购、赎回所支付、取得的对价并不等值。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

6、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；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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、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) 遵守基金管理人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额（包括场内份额和场外份额）拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金（即“华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“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直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份

额和计票时，联接基金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基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

#### 1、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、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

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

(2) 在不违反法律法规的规定及基金合同的约定、且对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式、调整基金份额类别;
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
- 6) 在符合有关法律法规的前提下, 经中国证监会允许, 基金管理人、代销机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则 (包括但不限于申购赎回清单的调整、场内及场外开放时间的调整等);
- 7) 基金推出新业务或服务;
- 8) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

- (1) 除法律法规规定或基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;
- (2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;
- (3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当由基金托管人自行召集, 并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人, 基金管理人应当配合。

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

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

### 4、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、通讯开会方式及法律法规、中国证监会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 50%（含 50%）；

3) 若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内, 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, 到会者所持有的有效基金份额应不少于在重新确定的权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

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

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);

4) 若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内, 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, 到会者所持有的有效基金份额应不少于在重新确定的权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一);

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

6) 会议通知公布前报中国证监会备案。

(3) 在不与法律法规冲突的前提下, 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、电话或其他监管机构允许的方式进行表决, 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, 授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式, 具体方式在会议通知中列明。

## 5、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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### 2) 通讯开会

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

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）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。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

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

## 7、计票

### (1) 现场开会

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

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

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

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

### (2) 通讯开会

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

## 8、生效与公告

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

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

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

### （三）《基金合同》解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### 1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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须报中国证监会备案，并自决议生效后 2 日内在指定媒介公告。

#### 2、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行适当程序后，基金合同应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

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

（3）基金合同约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### 3、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、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

（4）基金财产清算程序：

1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3) 对基金财产进行估值和变现；

4) 制作清算报告；

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

6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金剩余财产进行分配。



(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 4、清算费用

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

#### 5、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。

#### 6、基金财产清算的公告

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

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (四) 争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经一方提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费和律师费由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

### (五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立时间：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的

其他业务。

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债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的投资进行监督；

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、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）。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

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

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

2) 对基金投融资比例进行监督；

- a、 本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%，且不低于基金非现金资产的 80%；
- b、 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- c、 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- d、 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- e、 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%；
- f、 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%；

- g、 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%;
- h、 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%;
- i、 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;
- j、 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;
- k、 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
- l、 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%;
- m、 本基金在任何交易日日终,持有的买入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)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
- n、 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;
- o、 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;
- p、 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%;
- q、 每个交易日日终在扣除股指期货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;
- r、 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;
- s、 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- t、 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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所

导致的风险和损失；

u、 本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

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

2) 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) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

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规定的，基金管理人不得新增出借业务；

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

w、 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 i、s、t、u 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如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) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

(3) 基金托管人在上述第 (1)、(2) 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(4) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当视情况暂缓或拒绝执行，同时立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他

有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

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

## 2、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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

(3) 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会提交基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

## (三) 基金财产的保管

### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算账户。

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

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含募集股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致，基金募集的股票存放在以本基金和基金托管人联名名义开立的证券账户下。

(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及股票解冻事宜，基金托管人应提供协助。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

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

(3) 本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其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

## 4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

## 5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立资金结算账户，用于办理本基金现金差额或现金替代多退少补资金的结算。

(5) 因业务发展需要而开设的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，以及市场通行的习惯，由基金托管人负责开设。新账户按有关规则使用并管理。

(6) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 6、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；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

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

### (四) 基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(2) 基金管理人应每个交易日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个交易日结束后计算得出当日的该基



金份额净值，并以约定方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核且无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(3) 当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

(5) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后 4 位（含第 4 位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

(6) 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于不可抗力，或证券、期货交易所及存款银行发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

(2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，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，更新招募说明书并登载在指定网站上。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；基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点。基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金合同生效后，如果相关法律法规就基金财务报表与报告的编制规则及编制内容颁布新

的规定，基金管理人、基金托管人应依照届时有效的法律法规的规定，互相配合、互相监督，进行编制和披露。

### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

#### **1、基金份额持有人名册的内容**

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

#### **2、基金份额持有人名册的提供**

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

#### **3、基金份额持有人名册的保管**

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

### **（六）适用法律与争议解决方式**

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费和律师费由败诉方承担。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

### **（七）托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

#### **1、托管协议的变更**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与

《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

## 2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 本基金更换基金托管人；
- (3) 本基金更换基金管理人；
- (4) 发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构及申购赎回代理机构提供，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。

### （一）客户服务中心电话及在线服务

#### 1. 电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001 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：提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的人工服务。投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

#### 2. 在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的在线服务人工服务。投资人可通过该方式获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

### （二）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。

### （三）联系基金管理人

1、网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

2、客服邮箱：[cs4008880001@huatai-pb.com](mailto:cs4008880001@huatai-pb.com)

3、客服热线：400-888-0001（免长途话费），或 021-38784638

4、传真：021-50103016

5、联系地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

（四）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

二十四、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2023 年 05 月 28 日至 2024 年 05 月 31 日），下列公告在指定媒介披露：

公告名称	披露日期
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内分销证券的公告	2024-05-29
华泰柏瑞中证 500 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
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	2024-03-30
华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	2024-03-29
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	2024-03-29
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2024-03-28
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2024-02-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-02-21
华泰柏瑞基金管理有限公司关于对营业执照吊销客户采取限制交易措施的公告	2024-02-01
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2024-02-01
华泰柏瑞中证 500 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
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-01-06
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2024-01-05
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-12-26
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-12-23
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2023-12-16
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-12-16
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-12-13
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-12-01
华泰柏瑞基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	2023-11-08

华泰柏瑞中证 500 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
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-09-20
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止尚智逢源(北京)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-09-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-09-07
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-09-07
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-09-07
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告	2023-08-31
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司费率优惠活动的公告	2023-08-22
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-08-17
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	2023-08-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2023-08-08
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳新华信通基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2023-08-05
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-08-02
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	2023-07-21
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2023-07-12
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	2023-06-27
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-06-21
华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书 2023 年第 1 号	2023-06-17
关于同意东海证券股份有限公司为华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	2023-06-08
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-06-03

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 二十六、备查文件

- (一) 中国证监会准予华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- (二) 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二五年一月二十五日