

宏利中证500指数增强型证券投资基金（LOF）

更新招募说明书

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称本基金）由泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）更名而来。泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“原基金”）转型而来，原基金于 2011 年 8 月 24 日获中国证监会证监许可『2011』1338 号文核准募集，并于 2011 年 12 月 1 日起原基金基金合同正式生效；基金管理人于 2019 年 9 月 27 日以现场方式组织召开了原基金之基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。自 2019 年 11 月 6 日起，由《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

宏利基金管理有限公司（以下称“本基金管理人”或“基金管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

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

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

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

本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控

制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或违约等潜在风险，具体风险详见本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50% 的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本基金使用的指数增强量化投资策略用于增强收益目的，但并不基于量化策略进行频繁交易，本基金投资过程中多个环节将依赖于量化选股模型，存在量化选股模型失效导致基金业绩表现不佳的风险。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2025 年 11 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2025 年 9 月 30 日。财务数据未经审计。

目 录

重要提示	1
一、绪言	4
二、释义	5
三、基金管理人	10
四、基金托管人	20
五、相关服务机构	21
六、基金的历史沿革	47
七、基金存续	48
八、基金份额的上市交易	48
九、基金份额的申购与赎回	49
十、基金的标的指数	61
十一、基金的投资	63
十二、基金的业绩	76
十三、基金的财产	79
十四、基金资产的估值	79
十五、基金的收益与分配	84
十六、基金的费用与税收	85
十七、基金的会计和审计	87
十八、基金的信息披露	88
十九、风险揭示	94
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	99
二十一、基金合同的内容摘要	101
二十二、基金托管协议的内容摘要	117
二十三、对基金份额持有人的服务	128
二十四、其他应披露的事项	129
二十五、招募说明书存放及查阅方式	131
二十六、备查文件	131

一、绪言

《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定以及《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料变更注册而来。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

二、释义

《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF），本基金由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型而来

2、基金合同：指《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

3、招募说明书或本招募说明书：指《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新

4、托管协议：指《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充

5、上市规则：《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》

6、基金产品资料概要：指《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

7、上市交易公告书：《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》

8、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

9、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

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施并在 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修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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

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

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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布并于 2017 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》及不时做出的修订

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

16、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

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

18、元：指人民币元

19、基金管理人：指宏利基金管理有限公司

20、基金托管人：指中国银行股份有限公司

21、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证 500 指数，该指数是从上海和深圳证券市场中选取 500 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现

22、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

23、登记业务：指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者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

24、登记机构：指办理本基金登记业务的机构

25、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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

26、个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人

27、机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

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

29、基金份额持有人大会：指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议

30、基金合同生效日：指《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

33、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

34、T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数

35、申购：指在基金合同生效后的存续期间，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

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

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

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

39、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理本基金份额申购和赎回业务的基金销售机构和场所

40、场内：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理本基金份额申购、赎回和上市交易业务的机构或场所

41、登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

42、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统

43、上市交易：基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

44、转托管：指系统内转托管及跨系统转托管的总称

45、系统内转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

46、跨系统转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为

47、基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为

48、指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令

49、销售机构：指宏利基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位

50、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

51、基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放

式基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的登记结算系统

52、交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

53、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的证券登记结算系统

54、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

55、基金资产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57、基金份额净值指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值

58、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

59、法律法规：指中国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）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

60、指数编制机构：指中证指数有限公司

61、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

一、基金管理人概况

名称：宏利基金管理有限公司

设立日期：2002 年 6 月 6 日

住所：北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

办公地址：北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

法定代表人：DING WEN CONG（丁闻聪）

组织形式：有限责任公司

信息披露联系人：吴海燕

联系电话：010-66577739

注册资本：一亿八千万元人民币

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

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

利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利金利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利绩优增长灵活配置混合型证券投资基金、宏利泽利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利印度机会股票型证券投资基金（QDII）、宏利永利债券型证券投资基金、宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金、宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金、宏利泰和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利价值长青混合型证券投资基金、宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、宏利高研发创新 6 个月持有期混合型证券投资基金、宏利波控回报 12 个月持有期混合型证券投资基金、宏利消费服务混合型证券投资基金、宏利新能源股票型证券投资基金、宏利中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、宏利悠然养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利新兴景气龙头混合型证券投资基金、宏利景气领航两年持有期混合型证券投资基金、宏利中短债债券型证券投资基金、宏利先进制造股票型证券投资基金、宏利景气智选 18 个月持有期混合型证券投资基金、宏利昇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利闽利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、宏利悠享养老目标日期 2030 一年持有期混合型基金中基金（FOF）、宏利添盈两年定期开放债券型证券投资基金、宏利医药健康混合型发起式证券投资基金、宏利睿智成长混合型证券投资基金、宏利中债-绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、宏利半导体产业混合型发起式证券投资基金、宏利鑫享 90 天持有期债券型证券投资基金、宏利价值驱动六个月持有期混合型证券投资基金、宏利高端装备股票型证券投资基金、宏利中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、宏利中证 A500 指数增强型证券投资基金、宏利悦利利率债债券型证券投资基金、宏利中证 A50 指数增强型证券投资基金、宏利睿智领航混合型证券投资基金、宏利悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、宏利集享债券型证券投资基金在内的七十多只证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员基本情况

金旭女士，董事长，北京大学及美国纽约大学硕士研究生。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会工作。2001 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007 年 5

月至 2014 年 12 月任国泰基金管理有限公司总经理。2015 年 1 月至 2022 年 1 月先后任招商基金管理有限公司总经理及/或副董事长。2022 年 1 月至 2022 年 10 月任招商银行股份有限公司总行巡视员。2022 年 11 月加入宏利投资（上海）有限公司，现任中国区财富及资产管理主席及宏利投资（上海）有限公司执行董事、总经理兼法定代表人。2022 年 12 月 23 日起任公司董事长。

Gianni Fiacco 先生，董事。毕业于加拿大多伦多大学，持有商学学士学位，2000 年 9 月至 2005 年 9 月在加拿大普华永道会计师事务所担任经理，2005 年加入加拿大宏利金融，2013 年加入宏利投资管理（香港）有限公司担任亚洲办公室主任、副总裁，现为宏利投资管理（香港）有限公司亚洲区财富及资产管理新兴市场主管，负责新加坡、马来西亚、印度尼西亚、菲律宾、越南和印度的财富及资产管理新兴市场业务，并负责制定和实施业务战略，以实现公司在亚洲的增长目标。

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

DING WEN CONG（丁闻聪）先生，董事，多伦多大学硕士研究生。2010 年加入宏利金融，曾任集团战略企划部总监、宏利大中华区业务发展助理副总裁、宏利亚洲养老金业务战略及业务开发董事总经理等职位。2023 年起担任宏利投资（上海）有限公司财务负责人、总经理、法定代表人。2024 年 8 月加入宏利基金管理有限公司，担任公司总经理（法定代表人）、财务负责人。

查卡拉·西索瓦先生，独立董事。拥有艾戴克高等商学院（北部）工商管理学士、法国金融分析学院财务分析学位、芝加哥商学院工商管理学硕士等学位。曾担任欧洲联合银行（巴黎）组合经理助理、组合经理，富达管理与研究有限公司（东京）高级分析师，NatWest Securities Asia 亚洲运输研究负责人，Credit Lyonnais International Asset Management 研究部主管、高级分析师，Comgest 远东有限公司董事总经理、基金经理及董事。现任 Rating Agency of (Cambodia) Plc 执行董

事。

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

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

2、监事会成员基本情况

邓嘉明先生，监事会主席。拥有香港科技大学，工商管理硕士；资讯系统管理学硕士；香港城市大学，仲裁及争议解决学法学硕士学位。1986 年-1990 年在罗兵咸会会计师事务所担任审计主管，负责审计工作；1990 年-1996 年在香港证券及期货监察委员会担任中介团体监察科高级经理，负责监察工作；1996 年-1999 年在大和证券（香港）担任监察及内部核算部主管，负责监察及内部核算工作；1999 年-2002 年在汇富集团（Kingsway Group）担任监察科董事/业务拓展部董事，负责监察/业务拓展工作；2002 年-2003 年在 Alpha Alliance Group 担任营运总监，负责营运管理工作；2004 年-2007 年在景顺集团（INVESCO）担任监察科董事/业务拓展部董事，负责监察/业务拓展工作；2007 年-2008 年在荷银投资管理（亚洲）担任大中华区监察、法律及风险管理部门主管，负责监察、法律及风险管理工作；2008

年-2013 年在德意志资产管理有限公司担任监察部主管，负责监察工作；2013 年至今在宏利投资管理（香港）有限公司担任亚洲区财富及资产管理规管部主管，负责监察工作。

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

魏冰先生，职工监事。毕业于中南财经政法大学，曾就职于招商基金管理有限公司。2023 年 9 月加入宏利基金管理有限公司，任机构业务总监。

3、高级管理人员基本情况

DING WEN CONG（丁闻聪）先生，公司总经理（法定代表人）兼财务负责人，简历同上。

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

刁羽先生，副总经理，毕业于上海财经大学，金融数学与金融工程博士。2007 年 2 月至 2009 年 2 月任职于国泰君安证券股份有限公司，担任自营投资组交易员。2009 年 2 月至 2009 年 6 月任职于浦银安盛基金管理公司，担任基金经理助理。2009 年 6 月至 2014 年 3 月任职于富国基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理。2014 年 4 月至 2014 年 5 月任职于鑫元基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2023 年 7 月任职于中欧基金管理有限公司，历任固收投决会委员/投资总监/投资经理、基金经理。2023 年 7 月加入宏利基金管理有限公司，2023 年 9 月起任公司副总经理。

刘业伟先生，副总经理，毕业于对外经济贸易大学。2001 年 7 月至 2012 年 2

月，任职于中国工商银行股份有限公司，历任个人金融业务部理财业务处副处长。2012 年 2 月至 2015 年 4 月，任职于融通基金管理有限公司，历任首席产品官兼总经理助理。2015 年 5 月至 2019 年 2 月，任职于北京时间投资管理股份公司，历任总裁。2019 年 4 月至 2023 年 9 月，任职于工银瑞信基金管理有限公司，历任营销总监、上海分公司总经理。2023 年 9 月至 2025 年 4 月，任职于中信保诚基金管理有限公司，历任副总经理。2025 年 9 月加入宏利基金管理有限公司，2025 年 11 月起任公司副总经理。

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

唐华先生，首席信息官，毕业于上海复旦大学，2007 年 7 月至 2010 年 2 月任职于中国惠普有限公司。2010 年 2 月至 2011 年 3 月任职于上海吉贝克信息技术有限公司，2011 年 3 月至 2025 年 1 月任职于交银施罗德基金管理有限公司，历任信息技术部副总经理、信息技术部总经理等职务。2025 年 2 月加入宏利基金管理有限公司，现任公司首席信息官。

4、本基金基金经理

李婷婷女士：北京大学金融硕士研究生；2017 年 7 月加入宏利基金管理有限公司，曾任策略投资部助理研究员，研究员，现任策略投资部基金经理。2023 年 6 月 28 日至今担任宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；2024 年 7 月 30 日至今担任宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2024 年 7 月 30 日至今担任宏利消费行业量化精选混合型证券投资基金基金经理；2024 年 7 月 30 日至今担任宏利中证主要消费红利指数型证券投资基金基金经理；2024 年 7 月 30 日至今担任宏利沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理；2024 年 11 月 28 日至今担任宏利逆向策略混合型证券投资基金基金经理；2025 年 3 月 11 日至今担任宏利中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；2025 年 5 月 20 日至今担任宏利中证 A50 指数增强型证券投资基金基金经理。具备 8 年基金从业经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：

王咏辉先生（2011 年 12 月至 2012 年 08 月）；

杨超先生（2014 年 10 月至 2019 年 01 月）；

刘欣先生（2019 年 11 月至 2021 年 12 月）；

刘洋先生（2019 年 11 月至 2024 年 12 月）。

5、投资决策委员会

投资决策委员会成员：公司常务副总经理兼投资总监（权益）汪兰英、权益投资部执行总经理兼基金经理李坤元、研究部总经理兼基金经理孟杰、资产配置部兼策略投资部总经理兼基金经理张晓龙、基金经理刘晓晨、公司副总经理刁羽、固定收益部总经理兼基金经理孙甜、固收研究部总经理缪婧倩、固收研究部副总经理兼基金经理蔡熠阳、固定收益部副总经理兼基金经理余罗畅、基金经理李宇璐。

投资决策委员会根据决策事项，可分类为固定收益类事项、权益类事项、其它事项：

（1）固定收益类事项由刁羽（主任委员）、孙甜、缪婧倩、蔡熠阳、余罗畅、李宇璐表决。

（2）权益类事项由汪兰英（主任委员）、李坤元、孟杰、张晓龙、刘晓晨表决。

（3）其它事项由全体成员参与表决。

三、基金管理人的职责

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

2、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

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

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

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）承销证券；
- （4）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

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

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

（7）违反法律法规的规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（8）除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

（9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（10）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价

格，扰乱市场秩序；

- （11）贬损同行，以提高自己；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （13）以不正当手段谋求业务发展；
- （14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （15）其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

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

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

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

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

2、内部控制的体系结构

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

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任；

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

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

（4）风险控制部门：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

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

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

3、内部控制的措施

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

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

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

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：根据董事会及经营管理层的决定，由督察长通过监察稽核部门和风险控制部门组织各业务部门使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

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

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

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

4、基金管理人关于内部控制制度的声明

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

四、基金托管人

（一）基本情况

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

中国银行资产托管部设立于 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 2025 年 9 月 30 日，中国银行已托管 1176 只证券投资基金，其中境内基金 1107 只，QDII 基金 69 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

中国银行资产托管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。中国银行资产托管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）销售机构及联系人

1. 直销机构

（1）名称：宏利基金微信公众账号：manulifefund_BJ

支持快钱支付及农行快捷支付。

客户服务电话：4006988888/010-66555662

客户服务信箱：irm@manulifefund.com.cn

名称：宏利基金管理有限公司直销中心

住所：北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

办公地址：北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

联系人：刘恋

联系电话：010-66577617

客服信箱：irm@manulifefund.com.cn

客服电话：4006988888/010-66555662

传真：010-66577760/61

公司网站：www.manulifefund.com.cn

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

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

2. 代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

联系人：张伟

银行网站：www.abchina.com

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

客服电话：95566

联系人：刘文霞

银行网站：www.boc.cn

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客服电话：95533

联系人：王琳

银行网站：www.ccb.com

（4）交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

联系人：王菁

银行网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系人：季平伟

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（6）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

联系人：肖武侠

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（7）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

（8）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号兴业大厦 9 层

法定代表人：吕家进

客户服务电话：95561

联系人：李博

网站：www.cib.com.cn

（9）东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路 21 号

法定代表人：卢国锋

联系人：朱杰霞

客服电话：4001196228

公司网址：www.dongguanbank.cn

（10）宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

（11）上海银行股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：黄文娟

客服电话：95594

公司网站：www.bosc.cn

（12）中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法人代表：张金良

联系人员：李雪萍

客服电话：95580

公司网站：www.psbc.com

（13）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（14）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：霍学文

客户服务电话：95526

联系人：盖君

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（15）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人：王耀球

客服电话：0769-961122

联系人：洪晓琳

公司网站：www.drcbank.com

（16）江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：葛仁余

联系人：徐继军

客户服务热线：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

（17）中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号中国人寿广场 A 座 4 层

法定代表人：白涛

联系人：秦泽伟

电话：010-63631539

公司网址：www.e-chinalife.com

客服热线：95519

（18）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

联系人：权唐

公司网站：www.csc108.com

（19）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：95521

联系人：黄博铭

公司网站：www.gtja.com

（20）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

联系人：李颖

公司网站：www.guosen.com.cn

（21）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

（22）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：林传辉

客服电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

（23）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

客服电话：4008-888-888 或 95551

联系人：辛国政

公司网站：www.chinastock.com.cn

（24）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

客服电话：95553，400-8888-001

联系人：金芸

公司网站：www.htsec.com

（25）申万宏源证券有限公司

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

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：杨玉成

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

联系人：余洁

（26）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

（27）湘财证券股份有限公司

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

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

法定代表人：高振营

客服电话：95351

联系人：李欣

公司网站：www.xcsc.com

（28）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：安志勇

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

（29）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客户服务电话：95597

联系人：郭力铭

公司网站：www.htsc.com.cn

（30）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：张巍

联系人：金夏

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（31）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

联系人：何耀

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（32）中信证券华南股份有限公司

公司简称：中信证券（华南）

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

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

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

联系人：梁微

网址：www.gzs.com.cn

（33）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：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

（34）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 389 号

法定代表人：李剑锋

联系人：王万君

客户服务电话：95386

公司网址：www.njzq.com.cn

（35）诚通证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：张威

联系人：田芳芳

客户服务电话：95399

网址：www.cctgsc.com.cn

（36）平安证券股份有限公司

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

办公地址：深圳市福田区莲花街道金田路 4036 号荣超大厦 18 层

法定代表人：何之江

客服电话：0755-22627723

联系人：王阳

公司网站：www.stock.pingan.com

（37）国都证券股份有限公司

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

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

法定代表人：翁振杰

联系人：黄静

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（38）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（39）中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：宁敏

客服电话：400-620-8888

联系人：王炜哲

公司网站：www.bocichina.com

（40）世纪证券有限责任公司

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

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

法定代表人：余维佳

联系人：王雯

客服电话：4008323000

公司网站：www.csc.com.cn

（41）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：400-888-8228

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

（42）德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：武晓春

客服电话：400-888-8128

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

（43）华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：95547

联系人：王虹

公司网站：www.hfzq.com.cn

（44）国投证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：段文务

客服电话：95517

联系人:周楷钰

网址: www.essence.com.cn

(45) 财信证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋(B 座)26 层

办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 36 层(410005)

法定代表人: 刘宛晨

联系人: 刘智辉

客服电话: 95317

网址: www.cfzq.com

(46) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 王洪

客服电话: 95538

联系人: 张峰源 010-59013769

公司网站: www.zts.com.cn

(47) 申万宏源西部证券有限公司

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

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

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室(邮编:830002)

法定代表人: 王献军

电话: 0991-2307105

传真: 0991-2301927

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网址: www.swhysc.com

联系人: 梁丽

(48) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579 或 400-888-8999

联系人：奚博宇

长江证券客户服务网站：www.95579.com

（49）方正证券股份有限公司

注册地址：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

公司地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层

法定代表人：施华

联系人：丁敏

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

（50）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：冯鹤年

公司网址：www.msza.com

客服热线：400-619-8888

（51）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网站：www.gjzq.com.cn

（52）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

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

客服热线: 95548

(53) 西部证券股份有限公司

注册地址: 陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址: 陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人: 徐朝晖

客服电话: 95582

联系人: 张吉安

公司网站: www.west95582.com

(54) 中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人: 李永湖

联系人: 罗艺琳

公司网址: www.zszq.com

客服热线: 95329

(55) 华源证券股份有限公司

注册地址: 青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址: 湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F

法定代表人: 邓晖

联系人: 徐璐

客户服务热线: 95305

公司网址: www.huayuanstock.com

(56) 江海证券有限公司

注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 赵洪波

联系人: 周俊

公司网址: www.jhzq.com.cn

客服热线: 400-666-2288

（57）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层

法定代表人：王达

联系人：丁思

公司网址：www.wlzq.cn

客服热线：95322

（58）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

法定代表人：陈佳春

客服热线：95548

联系人：赵如意

公司网址：<http://sd.citics.com/>

（59）红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：沈春晖

公司网址：www.hongtastock.com

客服热线：400-871-8880

（60）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）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：刘加海

联系人：刘闻川

公司网址：www.cnhbstock.com

客服热线：400-820-9898

（61）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区金沙门路 32 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服热线：400-809-6096、95355

联系人：周青

公司网址：www.swsc.com.cn

（62）东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：陈照星

客服电话：95328

联系人：陈士锐

网站：www.dgzq.com.cn

（63）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

联系人：阴冠华

公司网址：www.cnht.com.cn

客服电话：956088

（64）中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608

办公地址：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 18-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛

联系人：夏锐

客户服务热线：95532

公司网站：www.ciccwm.com

（65）中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

联系人：梁美娜

公司网站：www.citicsf.com

（66）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

办公地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

法定代表人：金文忠

客服电话：95503

联系人：胡月茹

公司网站：www.dfzq.com.cn

（67）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：吴礼顺

客服电话：95358

联系人：单晶

网站：www.firstcapital.com.cn

（68）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：侯茂东

客户服务热线：95584

公司网站：www.hx168.com.cn

（69）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

联系人：杨赫、杨淑涵

客户服务热线：95325

公司网址：www.kysec.cn

（70）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市闵行区申滨南路1226号诺亚财富中心

法定代表人：吴卫国

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（71）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

（72）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（73）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：陶怡

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（74）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号

法定代表人：王珺

客服电话：95188-8

公司网址：www.fund123.cn

（75）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区滨江大道1111弄1号中企国际金融中心A座6楼

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

公司网址：www.erichfund.com

（76）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：章知方

客服电话：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

（77）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：吴强

客服电话：952555

公司网址：www.5ifund.com

（78）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

（79）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室

办公地址：上海市虹口区临潼路188号

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-118-1188

公司网址：<https://www.66liantai.com/>

（80）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路136号深圳新一代产业园2栋3401

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层

法定代表人：张斌

客服电话：4001661188-2

网址：<http://www.xinlande.com.cn>

（81）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（82）上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（83）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座4层

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网址：www.hcfunds.com

（84）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：简梦雯

客服电话：400-799-1888

公司网址：www.windmoney.com.cn

（85）京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

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

法定代表人：邹保威

客服电话：95118/4000888816

公司网站：kenterui.jd.com

（86）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：肖伟

客服电话：400-066-8586

公司网址：www.gesafe.com

（87）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼

法定代表人：李兴春

客服电话：4009217755

公司网址：http://www.leadfund.com.cn

（88）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人：汤蕾

客服电话：400-6099-200

公司网址： www.puzefund.com

（89）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

公司网址： www.jianfortune.com

（90）万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层

法定代表人：戴晓云

客服电话：010-59013825

公司网址： www.wanjiawealth.com

（91）腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼

法定代表人：谭广锋

客服电话：95017（拨通后转1转8）

公司网址： www.tenganxinxi.com

（92）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

客服电话：95510

公司网址： <http://fund.sinosig.com>

（93）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

（94）嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店
B座(2#楼)27楼2714室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座

法定代表人：张峰

客服电话：400-021-8850

公司网址：<https://www.harvestwm.cn>

（95）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（96）玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谱

客服电话：400-080-8208

公司网址：www.licaimofang.cn

（97）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市龙兰路277号1号楼1203、1204室

办公地址：上海市龙兰路277号1号楼1203、1204室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

公司网址：www.zhongzhengfund.com

（98）奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（99）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦603室

法定代表人：郑新林

客服电话：021-68889082

公司网址：<http://www.pytz.cn/>

客服电话：021-68889082

（100）大连网金基金销售有限公司

注册地址：中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202

办公地址：中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2F

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

（101）和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼503

法定代表人：温丽燕

客服电话：400—0555—671

公司网址：www.hgccpb.com

（102）泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206

办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦1206

法定代表人：彭浩

客服电话：400-004-8821

公司网址: www.taixincf.com

(103) 博时财富基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层

办公地址: 广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层

法定代表人: 王德英

客服电话: 400-610-5568

公司网址: www.boserawealth.com

(104) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址(公司地址): 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人: 毛淮平

客户服务电话: 400-817-5666

公司网址: www.amcfortune.com

(二) 注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街17号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人: 戴文华

联系人: 严峰

联系电话: 010-58598839

传真: 010-58598907

(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称: 上海市通力律师事务所

注册地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人: 俞卫锋

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至 1001-26

办公地址：北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至 1001-26

电话：010-66001391

传真：010-66001391

执行事务合伙人：肖厚发、刘维

经办会计师：曹阳、姜爱悦

联系人：曹阳

六、基金的历史沿革

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）由泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)更名而来。泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型而来。

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金经 2011 年 8 月 24 日中国证监会证监许可【2011】1338 号文核准募集，基金管理人为宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金自 2011 年 10 月 24 日至 2011 年 11 月 25 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 1 日生效。

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金于 2019 年 9 月 27 日以现场方式召开基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容主要包括泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更名称和基金类别、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额终止运作、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、申购赎回安排、收益分配原则和修订基金合同等事项。基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，决议生效后，基金管

理人实施基金转型。转型完成后，由《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，原《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

七、基金存续

一、基金份额的变更登记

自《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，且原《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效后，本基金登记机构将进行基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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的，按其规定办理。

八、基金份额的上市交易

一、上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

二、上市交易的地点

深圳证券交易所。

三、上市交易的时间

基金合同生效后六个月内，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金可以申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及其他有关规定。

五、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律规定、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转型为非上市开放式基金，本基金的基金名称将变更为“宏利中证 500 指数增强型证券投资基金”，除此之外，本基金的基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

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

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

九、基金份额的申购与赎回

本基金《基金合同》生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对基金份额进行日常的申购与赎回。

一、申购和赎回场所

基金投资者可以使用基金账户，通过基金管理人和其他场外销售机构，办理基

基金份额的场外申购和赎回业务。基金投资者也可使用深圳证券账户通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购和赎回业务，场内销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书中列明或见基金管理人网站公示的销售机构名录。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、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

本基金已于 2019 年 11 月 6 日起开放日常申购、赎回业务。

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

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、投资人在场外销售机构赎回基金份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人场外认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、场内申购、赎回需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按照新规定执行；

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立。登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

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

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

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

五、申购和赎回的数量限制

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

2、投资者可多次申购，本基金对单个投资人累计持有的基金份额不设上限。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

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。具体规定请参见相关公告。

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

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

6、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

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

养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：1、全国社会保障基金；2、可以投资基

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

申购费率具体如下表所示：

场外申购费率(通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户)	申购金额（M，含申购费）	费率
	M < 50 万	0.30%
	50 万 ≤ M < 250 万	0.25%
	250 万 ≤ M < 500 万	0.15%
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.10%
	M ≥ 1000 万	1000 元/笔
场外申购费率(本基金其他投资者)	申购金额（M，含申购费）	费率
	M < 50 万	1.20%
	50 万 ≤ M < 250 万	1.00%
	250 万 ≤ M < 500 万	0.60%
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.40%
	M ≥ 1000 万	1000 元/笔
场内申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率(本基金其他投资者)设定投资者的场内申购费率	

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

2、赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 天的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并上述赎回费全额计入基金资产，对持续持有期不少于 7 天的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

赎回费率具体如下表所示：

场外赎回费率	连续持有期限（日历日）	费率
	1 天～6 天	1.5%
	7 天（含）～365 天	0.5%

	366 天（含）～730 天	0.25%
	731 天（含）以上	0
场内赎回费率	本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%（对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费），并将上述赎回费全额计入基金资产	

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下，对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调整基金申购费率、调低基金赎回费率。

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

6、对特定交易方式（如：网上直销）的费率，基金管理人将另行公告。

7、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

8、法律、法规或监管部门另有规定的，从其规定。

七、申购和赎回的数额和价格

1、基金份额申购份额的计算

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

（1）基金份额申购

1）若适用比例费率时，申购基金份额的计算方法如下：

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

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

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

2) 若适用固定费用时, 申购份额的计算方法如下:

净申购金额 = 申购金额 - 固定费用

申购费用 = 固定费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

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

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

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) = 50000 / (1 + 1.20%) = 49407.11 元

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额 = 50000 - 49407.11 = 592.89 元

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金单位净值 = 49407.11 / 1.0160 = 48629.05 份

即: 投资者(非养老金客户)投资 5 万元申购本基金基金份额, 假定该笔申购申请被全部确认, 且申购当日基金份额净值为 1.0160 元, 则可得到 48,629.05 份基金份额。

2、基金份额赎回金额的计算

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

赎回金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

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

例如: 某投资者通过场外赎回本基金基金份额 1 万份, 持有期小于 1 年且大于 7 天, 对应的赎回费率为 0.50%, 假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元, 则可得到的净赎回金额为:

赎回金额 = 10000 × 1.0160 = 10160.00 元

赎回费 = 10160.00 × 0.50% = 50.80 元

净赎回金额=10160.00-50.80=10109.20 元

即:投资者通过场外赎回基金份额1万份,假设赎回当日基金份额净值是1.0160元,则其可得到的净赎回金额为10,109.20元。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。

八、申购和赎回的登记

1、基金投资者提出的申购和赎回申请,在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者T日申购基金成功后,基金登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记手续,投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者T日赎回基金成功后,基金登记机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前在指定媒介上公告。

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:

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

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、某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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：

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、某笔或某些赎回申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转

换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本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) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难，或认为支付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，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 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，以下一个开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

(3) 若基金发生巨额赎回的，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请情形下，按以下两种情形处理：

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

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

a. 对单个投资者超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请和未超过上一开放日基金总份额 20% 的赎回申请分开设定当日赎回确认比例，前者设定的赎回确认比例不高于对后者设定的赎回确认比例；

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

未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（4）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或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 2 日内在指定媒介上刊登公告。

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

3、场内巨额赎回的处理方式按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定执行。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

十三、基金转换

本基金已于 2019 年 11 月 6 日起开放基金转换业务，具体实施办法详见相关公告。

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

十四、基金份额的转让

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

十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而

产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

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

十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

1、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回或基金份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

十七、定期定额投资计划

本基金已于 2019 年 11 月 6 日起开放定期定额投资业务，具体实施办法详见相关公告。

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行

规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十八、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管部门另有规定的除外。

十九、基金的质押

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

二十、如法律法规、登记机构或深圳证券交易所的有关规则发生变化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十、基金的标的指数

一、标的指数简介

中证 500 指数由全部 A 股中剔除沪深 300 指数成份股及总市值排名前 300 名的股票后，总市值排名靠前的 500 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批中小市值公司的股票价格表现。

二、标的指数的编制方案

1、指数名称和代码

中文全称	中证小盘 500 指数	英文全称	CSI Smallcap 500 Index
指数代码	000905		
发布日期	2007 年 1 月 15 日	货币	人民币
基日	2004 年 12 月 31 日	基值	1000

2、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

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

3、指数选样方法

■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。

4、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值=Σ(证券价格×调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见《中证指数有限公司股票指数计算与维护细则》。

4、指数调整

(1) 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 10%。定期调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间的剩余证券（剔除沪深 300 指数样本及过去一年日均总市值排名前 300 名的证券后）前 90%的老样本可参与下一步日均总市值排名；日均总市值排名在 400 名之前的新样本优先进入，排名在 600 名之前的老样本优先保留。定期调整时设置备选名单，备选名单中证券数量一般为指数样本数量的 5%。

(2) 临时调整

特殊情况下将对中证 500 指数进行临时调整，当发生临时调整时，由最近一次指数定期调整时备选名单中排名最高的证券替代被剔除的证券。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照《中证指数有限公司股票指数计算与维护细则》处理。

5、指数发布

中证 500 指数发布的官方渠道有：

- （1）通过中证指数有限公司数据服务平台每日对外发布；
- （2）通过中证指数有限公司官方网站（www.csindex.com.cn）每日对外发布。

中证 500 指数信息以上述官方发布结果为准。

三、指数信息的查阅方式

投资者可登录中证指数有限公司官方网站（www.csindex.com.cn）免费查询指数信息及中证 500 指数编制方案，也可拨打中证指数有限公司咨询电话（021-50185500）了解有关信息。

四、标的指数的更新

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

十一、基金的投资

一、投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资组合中投资于中证

500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。

三、投资策略

本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

1、资产配置策略

本基金以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。

2、股票投资策略

为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略。

（1）指数复制策略

①定期调整

本基金将根据中证 500 指数成份股及其权重的定期调整，及时对股票投资组合进行相应调整，以控制投资组合与标的指数构成的偏离，从而实现对跟踪误差风险的控制。

②不定期调整

当成份股实施增发、配送或使股本发生变动等行为时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整；

当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整；

根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标指数的有效跟踪；

因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整；

在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

③特殊情形下的调整

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

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

（2）增强策略

在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，综合利用量化投资模型和指数增强技术，灵活地对投资组合进行调整，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

①多因子选股模型

本基金运用多因子选股模型，对基本面长期表现较好的股票进行筛选，并结合市场预判，选出优质个股进行投资。

多因子模型的因子包括：估值，成长，盈利质量，动量，流动性，市场情绪，波动率，市场敏感度等。公司的量化投研团队将对上述因子的有效性、市场逻辑、风格切换等进行持续的跟踪研究，并适时调整模型、因子类别和权重，力争保持模型的长期有效。

②风险管理

在风险管理方面，本基金将构建基本面风险模型和统计风险模型，对组合的风险敞口进行评估和管理，力争保持基金长期业绩的高信息比率。

③其它辅助增强策略

分析指数调整期间的调入调出个股的市场价格特征，在控制跟踪误差风险的前提下，有针对性地选择基金组合调整时机，以获取超额收益；

选择替代股票时，考查替代股票的投资价值。在满足作为替代股票的标准的前提下，选择具备较高投资价值的个股。

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

3、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合。

4、股指期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

5、资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

6、现金管理

在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作的流动性需求。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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；

（3）本基金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，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，

其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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；

（9）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；

（10）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（11）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（12）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（13）本基金参与股指期货交易，依据下列标准建构组合：

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

2）本基金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）不低于基金资产的 80%；

3）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

(14) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(15) 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条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 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；

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

(18) 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。

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，除上述第（3）项、第（8）项、第（15）项、第（16）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述规定的，本基金的投资不受上述限制或按照调整后的规定执行。

五、标的指数及业绩比较基准

（一）本基金的标的指数为：中证 500 指数。

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

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

（二）本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times 1 \text{ 年期定期存款利率（税后）}$

如果今后法律法规发生变化，或指数编制机构停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当的程序后变更业绩比较基准并及时公告。

如本基金调整标的指数的，本基金的业绩比较基准相应调整。变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开

基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项），本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

六、风险收益特征

本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

七、基金的投资组合报告

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 11 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2025 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	263,782,811.10	92.96
	其中：股票	263,782,811.10	92.96
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	16,073,024.19	5.66
	其中：债券	16,073,024.19	5.66
	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	2,510,895.29	0.88
8	其他资产	1,407,490.53	0.50
9	合计	283,774,221.11	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	81,540.00	0.03
B	采矿业	13,074,301.00	4.63
C	制造业	163,649,119.00	57.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,372,329.00	0.84
E	建筑业	1,371,857.00	0.49
F	批发和零售业	2,725,348.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	3,299,164.00	1.17
H	住宿和餐饮业	107,164.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,590,927.58	7.65
J	金融业	21,742,393.00	7.70
K	房地产业	790,415.00	0.28
L	租赁和商务服务业	168,453.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	2,324,370.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	418,646.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	235,012.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	4,932,068.00	1.75
S	综合	—	—
	合计	238,883,106.58	84.61

(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	1,381,942.00	0.49
C	制造业	15,779,931.13	5.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	325,530.00	0.12
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	964,988.65	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	76,849.00	0.03
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,504,498.79	0.89
J	金融业	2,126,044.00	0.75
K	房地产业	162,132.00	0.06
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	1,027,117.95	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	550,671.00	0.20

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,899,704.52	8.82

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	14,500	4,139,750.00	1.47
2	603893	瑞芯微	13,800	3,112,590.00	1.10
3	689009	九号公司	44,682	2,989,225.80	1.06
4	000783	长江证券	356,000	2,954,800.00	1.05
5	300627	华测导航	81,160	2,875,498.80	1.02
6	300251	光线传媒	145,000	2,808,650.00	0.99
7	688582	芯动联科	35,850	2,747,902.50	0.97
8	600435	北方导航	183,400	2,736,328.00	0.97
9	002624	完美世界	141,600	2,713,056.00	0.96
10	603379	三美股份	45,900	2,699,838.00	0.96

（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	603444	吉比特	3,000	1,704,000.00	0.60
2	300502	新易盛	3,500	1,280,195.00	0.45
3	300033	同花顺	2,700	1,003,779.00	0.36
4	000612	焦作万方	82,000	708,480.00	0.25
5	688103	国力电子	8,649	635,615.01	0.23

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	16,073,024.19	5.69
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	16,073,024.19	5.69

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	019758	24 国债 21	115,000	11,642,893.01	4.12
2	019773	25 国债 08	28,000	2,817,761.21	1.00
3	019766	25 国债 01	16,000	1,612,369.97	0.57

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

(3) 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

11、投资组合报告附注**(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**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长江证券股份有限公司于 2025 年 9 月 19 日曾受到国家外汇管理局湖北省分局公开处罚。胜宏科技(惠州)股份有限公司于 2025 年 4 月 16 日曾受到中华人民共和国梅沙海关公开处罚，于 2025 年 1 月 16 日曾受到中华人民共和国西永海关公开处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	51,027.43
2	应收证券清算款	1,252,284.22
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	104,178.88
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,407,490.53

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**a. 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

b. 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

(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

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

本基金合同生效日为 2019 年 11 月 6 日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

（一）历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较（截止到 2024 年 9 月 30 日）

宏利 500 指数增强（LOF）

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
自基金合同生效日起至 2019 年 12 月 31 日	6.15%	0.88%	4.60%	0.85%	1.55%	0.03%
2020 年 1 月 1 日至 2020	34.99%	1.52%	20.01%	1.54%	14.98%	-0.02%

年 12 月 31 日						
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	18.21%	0.96%	14.90%	0.92%	3.31%	0.04%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-19.27%	1.31%	-19.25%	1.31%	-0.02%	0.00%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	-9.58%	0.76%	-6.96%	0.78%	-2.62%	-0.02%
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	10.45%	1.61%	5.46%	1.73%	4.99%	-0.12%
2025 年 1 月 1 日至 2025	28.26%	1.14%	27.96%	1.21%	0.30%	-0.07%

年 09 月 30 日						
本基 金合 同生 效之 日起 至 2025 年 09 月 30 日	75.17%	1.25%	46.22%	1.28%	28.95%	-0.03%

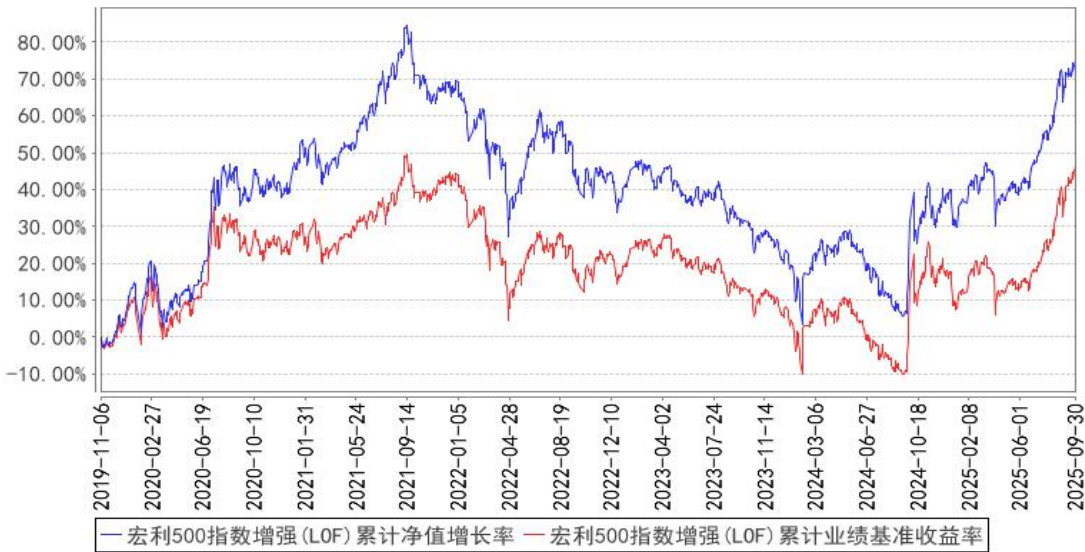
注：本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率*95%+1 年期定期存款利率(税后)*5%。

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

宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019 年 11 月 6 日至 2025 年 9 月 30 日）

宏利500指数增强(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

十三、基金的财产

一、基金资产总值

本基金的基金资产总值是指基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

1、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。

2、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。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。但基金管理人、基金托管人有权收取的管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用除外。

4、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、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、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）交易所上市的权益类证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的报价（收盘价）估值；估值日无报价的且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的报价（收盘价）估值；如有充分证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

（2）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（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。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（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日报价（收盘价）减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息（税后）后得到的净价进行估值；估值日无报价的且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的报价（收盘价）估值；如有充分证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

（4）对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。

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，以最近一日的报价（收盘价）估值；

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

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

3、全国银行间市场交易品种的估值

（1）银行间市场交易不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

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

（3）同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

4、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价值的情况下，按成本估值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值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工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且

采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个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信息按规定予以公布。

八、特殊情形的处理

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

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、第三方估值机构等发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十五、基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金

红利再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用

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

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、因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印

花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等）；

4、基金上市初费和上市月费

5、基金合同生效以后的信息披露费用（不包括自主披露产生的信息披露费用）；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效以后的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费，因基金投资的债券发生违约等事项进行追索产生的律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等相关费用；

8、基金资产的资金汇划费用；

9、基金财产投资运营过程中的增值税；

10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

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（根据《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的约定执行）；

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

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、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并履行适当程序后，调整基金管理费率、基金托管费率。调整基金管理费、基金托管费需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在指定媒介刊登公告。

五、基金税收

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

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、基金的会计和审计

一、基金会计政策

1、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度执行国家有关的会计制度。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、基金管理人为本基金的基金会计责任方。

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，基金托管人定期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及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒介公告。

3、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。

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。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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。

本基金《基金合同》生效后，基金管理人应将基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

（二）基金份额上市交易公告书

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

（三）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次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/基金份额上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在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。

（四）基金份额申购、赎回价格

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

（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

1、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。

2、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。

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

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

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流

动性风险分析等。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（六）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金终止上市交易、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理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；
- 9、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；
- 10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、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；
- 12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 13、基金收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生

变更；

- 15、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 16、本基金开始办理申购、赎回；
- 17、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、调整基金份额类别；
- 21、基金份额上市交易；
- 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；
- 23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

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。

（七）澄清公告

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

（八）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（九）投资资产支持证券的信息披露

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

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

（十）投资股指期货相关公告

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

（十一）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）等文件中披露量化交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示量化交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。本基金使用的指数增强量化投资策略用于增强收益目的，但并不基于量化策略进行频繁交易。

（十二）清算报告

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

（十三）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、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，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。其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露

同一信息的内容应当一致。

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

七、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

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

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

八、信息披露文件的存放与查阅

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

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

十九、风险揭示

本基金存在的主要风险有：

一、市场风险

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

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

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

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

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

二、信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资证券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

三、管理风险

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

四、流动性风险

指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

（1）拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。本基金投资管理以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略，严格按照法律法规的有关约定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，严格控制流动性受限资产的投资比例。在正常情况下，每日开放申购、赎回的机制安排、分散投资的制度安排等可以满足基金日常的投资管理需要及应对赎回的款项支付需求。在投资标的

发生停牌、违约等极端的、特殊的情况下，将在一定程度上影响本基金的资产变现能力及赎回款项支付能力。

（2）基金申购、赎回安排

投资者可以在开放式基金的开放日提出申购或赎回申请，但在极端的、特殊的市场情况下，可能无法满足投资者的日常申购或赎回申请。当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人将采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金申购、赎回安排的详细规则参见招募说明书第九部分。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在开放式基金申购、赎回过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能给基金仓位调整带来困难，产生流动性风险，甚至导致基金份额净值出现大幅波动。发生场外巨额赎回时，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可能采取部分延期赎回或暂停赎回、延缓支付赎回款项等流动性风险管理措施。投资者将面临不能及时赎回或延缓获得赎回款项的可能。场内巨额赎回的处理方式按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定执行。部分延期赎回或延期办理赎回申请的详细规则参见招募说明书第九部分第十一条。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

五、本基金特定投资策略带来的风险

本基金为股票型指数增强基金，存在的风险包括跟踪偏离风险、标的指数风险、跟踪误差未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务风险、成份股停牌或违约的风险。

跟踪误差风险：本基金管理人将尽责进行严格风险控制，并控制基金投资组合

与标的指数之间的跟踪误差及偏离度，但由于法律法规及其他限制，本基金不能投资于部分成分股；此外，在基金的日常运作中由于受到运作费用、交易成本、日常申购赎回以及市场流动性影响，不可避免的会产生与标的指数之间的跟踪偏离。

标的指数风险：标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

本基金使用的指数增强量化投资策略用于增强收益目的，但并不基于量化策略进行频繁交易，本基金投资过程中多个环节将依赖于量化选股模型，存在量化选股模型失效导致基金业绩表现不佳的风险。

跟踪误差控制未达约定目标的风险：本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，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。

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

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

成份股停牌或违约的风险：标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

在衍生品市场中，本基金将投资于股指期货。由于股指期货存在一定的作用机制，其将主要被用来套期保值，因此该类金融资产的投资风险主要为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：（1）需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；（2）因未

知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；（3）因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。同时在股指期货投资过程中还面对卖空风险（同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失）、杠杆风险（因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动）、平仓风险（在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓）等风险。

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

另外，本基金投资资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险。信用风险指基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。利率风险指资产支持证券的价格受利率波动而波动所产生的风险。流动性风险即证券的流动性下降从而给证券持有人带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）的可能性。提前偿付风险指若某些资产支持证券约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。操作风险指相关各方在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。法律风险指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

六、基金间转换所产生的风险

在基金间转换时，可能使相关的基金的规模发生较大改变，从而对转出和转入基金的原持有人利益产生影响。

七、其他风险

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

八、基金管理人职责终止风险

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

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

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

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人或临时基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及法律法规规定的其他人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

5、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

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

（一）基金管理人

名称：宏利基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

法定代表人：DING WEN CONG（丁闻聪）

成立日期：2002 年 6 月 6 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[2002]37 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及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：1.8 亿元人民币

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

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

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 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

存续期间：持续经营

（三）基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

（四）基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

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

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和利益分配等的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

（五）基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、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申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）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。

（六）基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

（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。

（七）基金托管人的义务

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、期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

（12）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款项；

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（八）基金份额持有人的权利

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

（九）基金份额持有人的义务

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》、《业务规则》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金申购款项、赎回费及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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

本基金不设立基金份额持有人大会日常机构。

（二）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）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金合同当事人权利、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。

（三）在不违反法律法规和《基金合同》的约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会：

（1）调低除基金管理费、基金托管费外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）调整本基金的申购费率、调低本基金的赎回费率或变更收费方式；
- （4）对《基金合同》的修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- （5）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则；
- （6）在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，基金推出新业务或服务；
- （7）增加、取消或调整基金份额类别设置；
- （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以外的其他情形。

（四）召集方式

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
- 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（五）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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（六）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人应当为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、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在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、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应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明；在会议召开方式上，在法律法规或监管机构允许的前提下，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（七）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（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。

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

持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（八）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（九）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）如果大会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、通讯方式开会

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。

（十）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。

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

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作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。

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

持有人大会审议。

三、《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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、关于基金合同的变更自基金份额持有人大会决议表决通过之日起生效，决议生效后两个工作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，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人或临时基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人或临时基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及法律法规规定的其他人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

5、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理

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

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

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

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、基金托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称： 宏利基金管理有限公司

住所： 北京市朝阳区针织路 23 号楼中国人寿金融中心 6 层 02-07 单元

法定代表人： DING WEN CONG（丁闻聪）

成立时间： 2002 年 6 月 6 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[2002]37 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本： 1.8 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

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称： 中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人： 葛海蛟

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

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

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、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定，对基金管理人的以下投资运作进行监督：

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；

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以

内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。

2、对基金投融资比例进行监督：

（1）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；

（2）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（3）本基金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，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合

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

②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

④本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产的 80%；

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

（5）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；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%（资产托管人项下义务仅限于监管由其担任资产托管人的资产管理人所管理全部基金财产的投资符合上述比例限制）；

（10）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；

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

（12）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；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与基金合同约定的投资范围保持一致，基金托管人不承担由于不一致所导致的风险或损失；

（13）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（14）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（15）本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（16）本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

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

（18）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。基金托管

人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。除上述第（3）、（10）、（11）、（12）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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

3、为对基金从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、法律法规规定的其他投资比例限制。

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

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及本协议的约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示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提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示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。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规及本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，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，或者违反本协议约定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）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。

三、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等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的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、证券账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、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。

（二）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。

（三）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令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，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。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，并对基金托管人给予积极配合和协助。

（四）基金证券账户、资金账户及其他投资账户的开设和管理

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、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。

（五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，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和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

（六）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。

（七）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。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）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。

2、基金管理人应每个开放日对基金财产估值。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资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的基金份额净值，并以双方约定的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，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，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、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 4 位内（含第 4 位）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、除本协议和基金合同另有约定外，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已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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证监会备案。

（二）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。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 2 个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 3 个月内予以公告。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，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中国证监会备案。

六、基金份额持有人名册的保管

（一）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。

（二）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。

（三）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、适用法律与争议解决方式

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

（二）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，对仲裁双方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

（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。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

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。

（二）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。

（三）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

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

一、基金投资者交易资料的对账服务

- （1）基金投资者可登陆本公司网站（www.manulifefund.com.cn）查阅对账单。
- （2）基金投资者也可向本公司定制电子或短信形式的对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

二、网上直销服务

- （1）网上交易系统网址：<https://etrade.manulifefund.com.cn/etrading>
- （2）宏利基金微信公众账号：manulifefund_BJ

三、客服电话服务

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

四、投诉建议受理

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

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

二十四、其他应披露的事项

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

1. 本基金管理人已于 2024 年 11 月 29 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》。

2. 本基金管理人已于 2024 年 11 月 29 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新》。

3. 本基金管理人已于 2024 年 12 月 7 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告》。

4. 本基金管理人已于 2025 年 1 月 22 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告》。

5. 本基金管理人已于 2025 年 1 月 22 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2024 年第 4 季度报告》。

6. 本基金管理人已于 2025 年 3 月 8 日发布《宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

7. 本基金管理人已于 2025 年 3 月 20 日发布《关于宏利基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

8. 本基金管理人已于 2025 年 3 月 31 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告》。

9. 本基金管理人已于 2025 年 3 月 31 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2024 年年度报告》。

10. 本基金管理人已于 2025 年 4 月 22 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告》。

11. 本基金管理人已于 2025 年 4 月 22 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年第 1 季度报告》。

12. 本基金管理人已于 2025 年 6 月 6 日发布《宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

13. 本基金管理人已于 2025 年 6 月 14 日发布《宏利基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新过期身份证件及补充完善身份资料信息的公告》。

14. 本基金管理人已于 2025 年 7 月 21 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告》。

15. 本基金管理人已于 2025 年 7 月 21 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年第 2 季度报告》。

16. 本基金管理人已于 2025 年 8 月 26 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金暂停接受大额申购、大额转换转入公告》。

17. 本基金管理人已于 2025 年 8 月 30 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告》。

18. 本基金管理人已于 2025 年 8 月 30 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年中期报告》。

19. 本基金管理人已于 2025 年 9 月 5 日发布《宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

20. 本基金管理人已于 2025 年 9 月 19 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）分红公告》。

21. 本基金管理人已于 2025 年 10 月 25 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）分红公告》。

22. 本基金管理人已于 2025 年 10 月 28 日发布《宏利基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告》。

23. 本基金管理人已于 2025 年 10 月 28 日发布《宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）2025 年第 3 季度报告》。

24. 本基金管理人已于 2025 年 11 月 1 日发布《宏利基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

注：公告事项披露在规定媒介及基金管理人网站上。

二十五、招募说明书存放及查阅方式

招募说明书分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额销售机构的住所，投资者可在办公时间查阅、复制；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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

二十六、备查文件

一、本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会准予基金变更注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、注册登记协议
- 8、中国证监会要求的其他文件。

二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式

1、存放地点：基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

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

宏利基金管理有限公司

2025 年 11 月 29 日