

建信基金管理有限责任公司

建信恒指港股通交易型开放式指数证券
投资基金招募说明书

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

二零二五年十二月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2025 年 11 月 3 日证监许可[2025]2435 号文注册募集。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：市场风险、管理风险、本基金特有风险、流动性风险、其他风险及本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。投资本基金可能遇到的特定风险包括：标的指数回报与证券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数值计算出错的风险、标的指数变更的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险、申购、赎回风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置风险、第三方机构服务的风险、基金退市风险、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品等金融衍生品交易风险、资产支持证券投资风险、投资存托凭证的风险、转融通证券出借风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、港股通投资风险等等，详见本基金招募说明书。

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要投资于标的指数

成份股及备选成份股，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征相似。本基金投资于港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

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

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

本基金为交易型开放式指数基金（ETF），将在上海证券交易所上市。投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记结算机构的相关业务规则，确保具备相关专业知识的方可参与本基金的申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代、现金差额等相关的交收方式已经认可。

投资人认购本基金时需具有上海证券账户，即投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或上海证券交易所证券投资基金账户。上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、

《基金合同》及基金产品资料概要等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

目 录

【重要提示】	1
第一部分 前言	5
第二部分 释义	6
第三部分 基金管理人	13
第四部分 基金托管人	21
第五部分 相关服务机构	23
第六部分 基金份额的发售	25
第七部分 基金备案	31
第八部分 基金份额折算与变更登记	33
第九部分 基金份额的上市交易	34
第十部分 基金份额的申购与赎回	36
第十一部分 基金的投资	49
第十二部分 基金的财产	59
第十三部分 基金资产估值	60
第十四部分 基金的收益与分配	67
第十五部分 基金费用与税收	69
第十六部分 基金的会计与审计	72
第十七部分 基金的信息披露	73
第十八部分 风险揭示	81
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	94
第二十部分 基金合同的内容摘要	97
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要	98
第二十二部分 对基金份额持有人的服务	99
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式	103
第二十五部分 备查文件	104
附件一 《基金合同》内容摘要	105
附件二 《托管协议》内容摘要	123

第一部分 前言

《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“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《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、上市交易公告书：指《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《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

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、《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

15、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

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

18、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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

22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

24、合格境外投资者：指符合相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

销售对象的范围予以进一步限定或调整，具体销售对象见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告

26、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》所定义的机构投资者

27、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

28、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回及转托管等业务

29、销售机构：指直销机构和其他销售机构

30、直销机构：指建信基金管理有限责任公司

31、其他销售机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件，取得基金销售业务资格并办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理机构

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

33、申购赎回代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司

34、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

35、登记机构或基金登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

36、上海证券账户：指投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或上海证券交易所证券投资基金账户

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

38、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产

清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

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

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

42、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

43、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

44、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的港股通交易日

45、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

46、《业务规则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则、规定、通知及指南等

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

48、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定，以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人申请购买基金份额的行为

49、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为申购赎回清单所规定的赎回对价的行为

50、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

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

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

53、标的指数：指恒指港股通指数及其未来可能发生的变更

54、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

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

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

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

58、基金份额参考净值：指基金管理人或基金管理人委托的其他机构在交易时间内根据基金管理人提供的申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据及汇率数据计算，计算并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

59、预估现金部分：指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额

60、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总数及基金份额净值

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

62、元：指人民币元

63、基金收益：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

64、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

65、收益评价日：指基金管理人计算本基金份额净值增长率与标的指数同期增长率差额之日

66、基金份额净值增长率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算日或拆分、合并日为初始日重新计算）

67、标的指数同期增长率：指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算日或拆分、合并日为初始日重新计算）

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

69、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

70、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得价值

71、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

72、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

73、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具

74、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方

75、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方

76、名义本金：亦称交易名义本金，指一笔信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准

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

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

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

80、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

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

成立日期：2005年9月19日

法定代表人：生柳荣

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：中国建设银行股份有限公司，65%；信安金融服务公司，25%；中国华电集团产融控股有限公司，10%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等高级管理人员的评价和奖惩权。

董事会下设审计委员会，审计委员会按照《公司法》及其他法律法规、监管规定及公司章程的规定行使监督职权，包括检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员执行职务等。

二、主要人员情况

1、董事会成员

生柳荣先生，董事，现任建信基金管理有限责任公司董事长。厦门大学经济学博士。历任中国建设银行厦门市分行和总行金融市场部、资产负债管理部等部门主要负责人，现任中国建设银行首席财务官。2023年9月兼任建信基金管理有限责任公司党委书记，9月26日兼任建信基金管理有限责任公司董事长。

谢海玉女士，执行董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁。毕业于对外经济贸易大学金融学专业，获博士学位。历任中国建设银行总行资金部科员、香港资金交易室一级业务员、资金交易部业务经理、高级副经理、金融市场部处长等职务；2017年7月起历任建信金融资产投资有限公司首席投资官、副总裁等职务，2018年8月起兼任建信金投私募基金管理（北京）有限公司[原建信金投私募基金管理（天津）有限公司]执行董事（至2024年11月）、总经理（至2024年1月）；2024年11月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记；2024年12月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记、总裁、执行董事。

钟蓉萨女士，董事，现任美国信安金融集团副总裁、中国区负责人。毕业于中国人民大学统计学专业，获经济学学士学位。历任中国证监会信息统计部信息中心主任科员、副处长、处长和机构监管部处长，中国证券业协会党委委员、副秘书长，中国证券投资基金业协会党委委员、副秘书长、副会长。

陈惠燕女士，董事，现任信安亚洲区财务总监。1993年毕业于新加坡南洋理工大学，获学士学位。2001年毕业于悉尼理工大学，获硕士学位。2002年至2021年，在英国保诚集团旗下翰亚投资公司工作，历任亚洲总部财务部经理、财务部高级经理、财务部副总监和财务总监。

王晓波先生，董事，现任中国华电集团产融控股有限公司党委委员，副总经理、总会计师。毕业于哈尔滨建筑大学，研究生学历。历任黑龙江省物资对外贸易公司会计，华电能源股份有限公司监察审计部审计员、副经理、主任，华鑫国际信托有限公司计划财务部负责人、总经理，华鑫国际信托有限公司信托财务管理部总经理，华鑫国际信托有限公司运营总监兼信托财务管理部总经理，华鑫国际信托有限公司副总经理，中国华电集团资本控股有限公司审计部主任。

吴岚女士，独立董事，现任北京大学数学科学学院金融数学系主任、教授。1999年获北京大学理学博士学位。1990年硕士研究生毕业后在北京大学（原）概

率统计系、数学科学学院金融数学系担任教学科研工作。2003 年至今担任北京大学数学科学学院金融数学系主任。

姚磊先生，独立董事，现任华领私募股权基金管理（北京）有限公司总经理。毕业于对外经济贸易大学，获硕士学位。历任中国国际金融有限公司投资银行部经理、高级经理、副总经理、执行总经理，公司管理部董事总经理，首席财务官；厦门博润资本投资管理有限公司总经理。

王遥女士，独立董事，现任中央财经大学教授，博士生导师。中央财经大学绿色金融国际研究院院长，中央财经大学 - 北京银行双碳与金融研究中心主任，财经研究院、北京财经研究基地研究员。中国金融学会绿色金融专业委员会副秘书长，中国证券业协会绿色发展委员会顾问。剑桥大学可持续领导力研究院研究员，牛津大学史密斯企业与环境学院可持续金融项目咨询委员会专家，卢森堡证券交易所咨询顾问。2021 担任联合国开发计划署中国生物多样性金融“BIOFIN”项目首席技术顾问；之前任 SDG 影响力融资研究与推广首席顾问。

莫红女士，职工董事，现任建信基金管理有限责任公司副总裁。毕业于四川大学刑事诉讼法证据法学专业，获博士学位。曾在四川省高级人民法院、四川省纪委监委、四川省纪委监委任职，从事涉及经济、金融方面的法律工作和对金融企业的纪检监察工作。2021 年 8 月任中国建设银行资产保全部负责人。2023 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2024 年 2 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、首席运营官，2024 年 10 月任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、首席运营官。

2、公司高管人员

谢海玉女士，总裁（简历请参见董事会成员）。

莫红女士，副总裁（简历请参见董事会成员）。

张铮先生，副总裁、财务负责人，硕士。1997 年 4 月加入中国建设银行总行，先后在资金计划部、计划财务部、资金部、资金交易部、金融市场部、香港资金运营中心、财富管理与私人银行部、私人银行部等部门工作，曾长期从事金融市场研究、资金交易、本币投资等业务。2024 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 1 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁，

2025 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、财务负责人。

刘大超先生，副总裁，硕士。曾在合肥三字集团工作。2003 年 7 月加入中国建设银行总行，先后在基金托管部、投资托管服务部、资产托管业务部工作，长期从事基金托管业务。2025 年 7 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁。

吴曙明先生，首席风险官、督察长，硕士。1992 年 7 月至 1996 年 8 月在湖南省物资贸易总公司工作；1999 年 7 月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006 年 3 月加入建信基金管理有限责任公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司督察长、董事会秘书，2016 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁（首席风险官）、督察长，2017 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁（首席风险官）、督察长，2024 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、督察长，2025 年 4 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁、督察长，2025 年 11 月起职务名称由副总裁更名为首席风险官，并继续担任督察长。

3、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

4、基金经理

刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 17 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 7 月 29 日起任建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。

5、公司投资决策委员会成员

谢海玉女士，总裁。

张 铮先生，副总裁。

吴曙明先生，首席风险官。

陈正宪先生，总裁特别助理。

乔 梁先生，投研总监。

陶 灿先生，权益投资部总经理。

陈建良先生，固定收益投资部总经理。

田元泉先生，研究部总经理。

江 源女士，多元资产投资部副总经理。

叶乐天先生，数量投资部副总经理。

姜晓辰女士，国际投资与业务发展部总经理。

卜 蕊女士，基础设施投资部总经理。

解一辉女士，投资风险管理部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，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、会计账册、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、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

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

3、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不得以任何形式为其它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。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

(2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

(3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4) 有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

(5) 防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，

在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。

(6) 适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

2、内部控制的主要内容

(1) 控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立了审计委员会和风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总裁领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理与内控合规委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

(2) 风险评估

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

(3) 操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互

牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

（5）监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的风险与合规管理部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

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、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、基金托管业务经营情况

截至2025年6月30日，中国银行已托管1156只证券投资基金，其中境内基金1088只，QDII基金68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、基金托管人的内部控制制度

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。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：生柳荣

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

2、网下现金发售代理机构详见基金份额发售公告。

3、网上现金发售代理机构详见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的其他机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

二、基金份额登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

联系地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

联系人：严峰

电话：010-59378856

传真：010-59378907

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：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：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈雅秋

经办律师：陆奇、陈雅秋

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

联系人：马剑英

经办注册会计师：高鹤、马剑英

第六部分 基金份额的发售

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会 2025 年 11 月 3 日证监许可[2025]2435 号文注册。

二、基金的类别

股票型证券投资基金

三、基金的运作方式

交易型开放式

四、基金存续期限

不定期

五、基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

六、发售方式

投资人可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

发售代理机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售代理

机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

投资人也可以通过基金管理人及各销售机构的基金销售网点参与本基金的场外认购，基金管理人可以决定是否开放场外认购，具体的发售安排见基金份额发售公告。

七、发售对象

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

八、投资人对基金份额的认购

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、认购开户

投资人认购本基金时需具有上海证券账户，即投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或上海证券交易所证券投资基金账户。上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

（1）如投资人需新开立证券账户，则应注意：

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

（2）如投资人已开立证券账户，则应注意：

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

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

3）使用专用席位的机构投资者无需办理指定交易。

3、账户使用注意事项

已购买过由建信基金管理有限责任公司担任登记机构的基金的投资人，其拥有的建信基金管理有限责任公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

九、认购费用

募集期投资人可以多次认购本基金，按每笔认购份额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。基金投资人认购本基金基金份额时收取认购费用。

本基金基金份额的认购费率如下表所示。

认购份额 (M)	认购费率
M<50 万	0.8%
50 万≤M<100 万	0.5%
M≥100 万	每笔 1,000 元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

十、网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算：

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

认购佣金=认购份额×认购价格×佣金比率

（若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购份额×认购价格×（1+佣金比率）

（若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资人通过某发售代理机构采用现金方式认购 100,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，则投资人需支付的认购佣金和需准备的资金金额的份额计算如下：

认购佣金=100,000×1.00×0.8%=800.00 元

认购金额=100,000×1.00×（1+0.8%）=100,800.00 元

即：某投资人通过某发售代理机构采用网上现金方式认购 100,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，该投资人需准备 100,800.00 元资金，可得到 100,000 份本基金基金份额。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资人可以多次认购，单个投资人的累计认购不设上限。

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

5、清算交收：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 个工作日内将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十一、网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用 = 认购份额 × 基金份额发售面值 × 认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用 = 固定费用）

认购金额 = 认购份额 × 基金份额发售面值 × (1 + 认购费率)

（或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用）

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

通过基金管理人以网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购 100,000 份本基金，认

购费率为 0.8%，假设认购资金在募集期间产生的利息为 10.00 元，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

$$\text{认购费用} = 100,000 \times 1.00 \times 0.8\% = 800.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 100,000 \times 1.00 \times (1 + 0.8\%) = 100,800 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 10.00 / 1.00 = 10 \text{ 份}$$

$$\text{投资人实际可得份额} = 100,000 + 10 = 100,010 \text{ 份}$$

即，某投资人通过基金管理人以网下现金方式认购 100,000 份本基金，认购费率为 0.80%，认购资金在募集期间产生的利息为 10 元，该投资人需准备 100,800 元资金，加上认购资金在募集期间产生的利息折算的份额后，一共可得到 100,010 份本基金基金份额。

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

3、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。在本基金首次募集规模上限内，投资人可以多次认购，单个投资人的累计认购不设上限。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

5、清算交收：T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第 4 个工作日内将汇总的认购款项及其利息划往基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资人所有。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 个工作日内将实际

到位的认购资金划往基金募集专户。

6、认购确认：基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十二、募集资金利息与募集证券权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

十三、募集期认购资金的处理方式

募集期间的认购资金存入专用账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

十四、增设新的份额类别或发行联接基金等相关业务

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，为本基金增设新的份额类别，或开通场外申购、赎回等相关业务并制定、公布相应的业务规则等，或募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，无须召开基金份额持有人大会审议。

第七部分 基金备案

一、基金备案的条件

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

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

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

2、在基金募集期限届满后30日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，若连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时（包括但不限于法律法规或中国证监会规定

发生变化，上述规定被取消、更改或补充等)，从其规定。

第八部分 基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，基金管理人可根据基金运作需要进行基金。

一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算基准日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（因尾数处理而产生的损益不视为实质性影响）。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的上市交易

一、基金上市

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

- 1、基金场内募集金额不低于 2 亿元；
- 2、场内基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、上海证券交易所规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

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

三、终止上市交易

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起依照《信息披露办法》发布基金终止上市公告。

若因上述 1、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，而无需召开基金份额持有人大会。有关本基金转换基金运作方式的相关事项见基金管理人届时相关公告。届时，基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整

申购赎回等业务规则。

四、基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据基金管理人提供的申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据及汇率数据计算并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值的具体计算方法如下：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量、最新成交价以及汇率公允价的乘积之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购赎回单位对应的基金份额

汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价、中国外汇交易中心公布的参考汇率、指数编制机构在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人审慎决定的其他公允价格等。

基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。若上海证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将进行相应调整。

在未来条件允许的条件下，本基金可以参考上述公式，委托其他机构在相关证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算本基金基金份额参考净值（港币）。

上海证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

五、相关法律法规、中国证监会、登记机构或上海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，本基金按照新规定执行，由此对基金合同进行修订的，无须召开基金份额持有人大会。

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

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

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理机构提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理机构的名单，并可依据实际情况变更或增减申购赎回代理机构，并在基金管理人网站公告。

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

未来，本基金管理人可根据市场和产品运行情况，适时增加场外申购赎回业务。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为港股通交易日，但基金管理人公告暂停申购或赎回等业务时除外。投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理开放时间见招募说明书或相关公告。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照

《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

三、申购与赎回的原则

1、“份额申购、份额赎回”的原则，即本基金的申购、赎回均以份额申请；

2、本基金申购、赎回的币种为人民币；基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增加其他币种的申购、赎回，其他币种申购、赎回的具体规则届时将另行公告；

3、本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额和/或其他对价；

4、申购与赎回申请提交后不得撤销；

5、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定；如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及基金管理人修改或更新《业务规则》的，则本基金的申购、赎回按照新的规则执行，并在更新的招募说明书或相关公告中进行披露。

基金管理人可根据基金运作的实际情况，在法律法规允许的情况下，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，或依据上海证券交易所或登记机构相关规则及其变更调整上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在规定媒介上予以公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的赎回对价，则赎回成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。

2、申购和赎回申请的确认

投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎

回申请失败。

申购赎回代理机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理机构确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。投资者可通过其办理申购、赎回业务的销售机构或者销售机构规定的其他方式查询确认情况。

本基金获批后，若上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司推出可适用于本基金的新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人将根据新的业务规则新增或调整申购和赎回申请的确认方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的基金合同和招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。

3、申购和赎回申请的清算交收与登记

本基金的申购和赎回的清算交收与登记规则适用《业务规则》及与各方相关协议的有关规定，详见招募说明书。如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行。

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

1) 申购的清算交收

投资者 T 日提交的申购申请受理后，日间完成 RTGS 交收部分，登记机构在 T 日日间实时办理基金份额登记及现金替代的交收；T 日日间未完成 RTGS 交收部分，登记机构在 T 日日终为该投资者办理基金份额登记及现金替代的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。基金管理人在 T+2 日内办理现金差额的清算交收。

2) 赎回的清算交收

投资者 T 日提交的现金赎回申请受理后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。基金管理人在 T+2 日内办理现金差额的清算交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 7 个开放日内划往基金份额持有人账户。若发生特殊情况（包括但不

限于基金投资市场交易清算规则发生较大变化、港股通暂停交易或交收、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出等), 基金管理人可以对清算交收日期进行相应调整。

如果基金管理人和登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形, 则依据《业务规则》及与各方相关协议进行处理。

基金管理人及登记机构可在法律法规允许的范围内, 对清算交收与登记的办理时间、方式进行调整, 基金管理人将在调整实施前依照有关规定在规定媒介上予以公告。

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

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人综合考虑对投资组合跟踪误差的影响以及市场需求等因素确定, 并在其他公告中列明。

2、基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限, 具体规定详见招募说明书或其他相关公告。

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份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施, 切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要, 可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

4、基金管理人可根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 调整上述规定数量或比例限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入,

由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额和/或其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的现金替代、现金差额和/或其他对价。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。申购赎回清单的内容与格式见下文“七、申购赎回清单的内容与格式”。

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

基金管理人可以在不违反相关法律法规、不违反基金合同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对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并公告。

七、申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

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

2、组合证券相关内容

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

3、现金替代相关内容

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

(1) 现金替代分为两种类型：可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

可以现金替代是指当投资人申购或赎回基金份额时，允许使用现金作为组合证券的替代，基金管理人按照申购赎回清单要求，代理投资人买入或卖出组合证券，

并与投资人进行相应结算。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

1) 适用情形：可以现金替代的组合证券是需要投资人现金申购或赎回时代理投资人买入或卖出的组合证券。

2) 申购现金替代保证金：对于可以现金替代的组合证券，申购现金替代保证金的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券 T 日预计开盘价×T-1 日估值汇率

申购现金替代保证金=替代金额×（1+现金替代溢价比例）

收取溢价的原因是，基金管理人需要在收到申购确认信息后买入相应的组合证券，实际的结算成本与替代金额可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取申购现金替代保证金。如果预先收取的申购现金替代保证金高于购入该部分组合证券的实际结算成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的申购现金替代保证金低于基金购入该部分组合证券的实际结算成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

3) 申购现金替代保证金的处理程序

对于确认成功的 T 日申购申请，T 日内基金管理人根据申购规模进行组合证券的代理买入。T 日日终，基金管理人根据所购入的被替代组合证券的实际单位购入成本、实际购入的相关费用、未购入的被替代组合证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率，基金管理人可根据情况调整所使用的折算汇率，并及时公告；被替代组合证券 T 日无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后收盘价）计算并确定被替代组合证券的单位结算成本，在此基础上根据替代组合证券数量和现金替代保证金确定基金应退还投资人的款项或投资人应补交的款项。T 日后的两个工作日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理买入及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券

长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算成本进行调整。如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

4) 赎回替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请，T 日内基金管理人根据所卖出的被替代组合证券的实际单位卖出成本、实际卖出的相关费用、未卖出的被替代组合证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率，基金管理人可根据情况调整所使用的折算汇率，并及时公告；被替代组合证券 T 日无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后收盘价）计算并确定被替代组合证券的单位结算成本，在此基础上根据替代组合证券数量确定赎回替代金额。T 日后的第 3 个港股通交收日后的两个工作日内，基金管理人将应支付的赎回现金替代款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

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

5) 未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或《业务规则》发生改变，或基金管理人与基金托管人及申购赎回代理机构之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可以对上述可以现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。

(3) 必须现金替代

1) 适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成分证券、或法律法规限制投资的证券、或相关交易制度限制交易的证券、或基金管

理人出于保护基金份额持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

2) 替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其 T 日预计开盘价并按照 T-1 日估值汇率换算或基金管理人认为合理的其他方法。

4、预估现金部分相关内容

指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金部分由申购赎回代理机构预先冻结。

预估现金部分的计算公式为：

$$T \text{ 日预估现金部分} = T-1 \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额} + \text{申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量} \times T \text{ 日预计开盘价} \times T-1 \text{ 日估值汇率乘积之和})$$

若 T 日为基金分红除息日，则预估现金部分需进行相应的调整。

预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

$$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量} \times T \text{ 日收盘价} \times T \text{ 日估值汇率相乘之和})$$

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

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

6、申购赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	202*-**-**
基金名称	建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	建信基金管理有限责任公司
基金代码	*****

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	
最小申购赎回单位净值（单位：元）	
基金份额净值（单位：元）	

T 日信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分（单位：元）	
现金替代比例上限	
当日累计可申购的基金份额上限	
当日累计可赎回的基金份额上限	
当日净申购的基金份额上限	
当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日净申购的基金份额上限	
单个证券账户当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可申购的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可赎回的基金份额上限	
是否需要公布 IOPV	
最小申购、赎回单位（单位：份）	
申购赎回的允许情况	
申购赎回模式	

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量（股）	现金替代标志	申购现金替代溢价比例	赎回现金替代折价比例	替代金额（单位：人民币元）	挂牌市场

若上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 3、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；
- 4、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 6、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购份额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购份额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购份额超过单个投资人单日或单笔申购份额上限时；
- 7、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 8、相关证券交易所、申购赎回代理机构、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 9、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单或开市后发现 IOPV 计

算错误、申购赎回清单编制错误；

10、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，基金管理人可以暂停接受基金申购申请；

11、港股通每日额度不足；

12、港股通的业务规则发生重大变化时；

13、基金投资者未向基金管理人提供或更新法律法规要求的反洗钱等尽职调查等事项所需的基金投资者信息；

14、基金投资者存在洗钱风险较高的情形，基金管理人认为需要采取强化措施以管理和降低洗钱风险时；

15、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第 5、6、13、14 项以外的情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登相关公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并予以公告。

九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价；

2、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；

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

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

5、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回份额上限，如果一笔新的赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；

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

7、港股通的业务规则发生重大变化时;

8、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第 5 项以外的情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回对价时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登相关公告。已接受的赎回申请,基金管理人应当足额兑付。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、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证券交易所以外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。

十一、其他

1、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人可开放集合申购即允许多个投资人集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

在条件允许时,基金管理人也可采取其他合理的申购方式,并于新的申购方式开始执行前予以公告。

2、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务,双方需签订书面委托代理协议,并报中国证监会备案。

3、在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人在与基金托管人协商一致后,可为本基金增设新的份额类别,制定并公布相应的业务规则。

4、对于符合相关法律法规要求的特定机构投资者,基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,安排专门的申购方式,

并于新的申购方式开始执行前另行公告。

5、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以根据具体情况履行适当程序后开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

6、若上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并在本基金基金合同、招募说明书及其更新中予以更新，无须召开基金份额持有人大会审议。

7、在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可为本基金增设新的份额类别，制定并公布相应的业务规则。

8、基金管理人可在法律法规允许的范围内且在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，并在调整实施前在规定媒介进行公告。

十二、联接基金的投资

本基金的联接基金可投资于本基金，与本基金跟踪同一标的指数。

十三、基金的转托管

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

十四、基金份额的非交易过户、冻结、解冻等其他业务

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

十五、联接基金的特殊申购

若基金管理人推出以本基金为目标 ETF 的联接基金，本基金可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，不收取申购费用。

第十一部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

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

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

三、标的指数及其编制信息

（一）标的指数

恒指港股通指数。

（二）编制方案

1、选股范畴：恒生指数（「基础指数」）成份股。

2、成份股挑选方法：所有符合港股通资格的证券

3、成份股数目：非固定

4、加权方式：流通市值加权（经倾斜因子调整，即于比重上限计算当日，指数的行业比重将设定与基础指数相关行业比重相等）

5、权重上限：非外国公司成份股：8%（个股）；外国公司成份股：4%（个股），10%（合计）

6、检讨周期：每季（数据截至每年三月底、六月底、九月底及十二月底），比重调整周期为每季。

（三）指数信息查询

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见恒生指数有限公司网站，网址：www.hsi.com.hk。

四、投资策略

在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 3%。

1、股票投资策略

本基金通过港股通机制投资标的指数的成份股、备选成份股。

本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的，尽量降低跟踪误差。特殊情形包括但不限于：1）法律法规的限制；2）标的指数成份股流动性严重不足；3）标的指数的成份股票长期停牌；4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并等公司行为；5）标的指数成份股派发现金股息；6）指数成份股定期或临时调整；7）标的指数编制方法发生变化；8）港股通额度受限；9）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市等风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

2、存托凭证的投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。

3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下管理策略：

（1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、地方政府债、可转债等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取适当的超额收益。

（4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、可转换债券、可交换债券投资策略

本基金可投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券以及其他含权债券等，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类含权债券的债券价值和权益价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；权益价值方面仔细开展对含权债券所对应个股的价值分析，包括估值水平、盈利能力及未来盈利预期，此外还需结合对含权条款的研究综合判断内含期权的价值。本基金力争在市场低估该类债券价值时买入并持有，以期在未来获取超额收益。

6、股指期货交易策略

本基金参与股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金参与股指期货的交易策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7、股票期权投资策略

基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规

和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

8、国债期货交易策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。国债期货相关交易遵循法律法规及中国证监会的规定。

9、信用衍生品投资策略

本基金投资信用衍生品，按照风险管理原则，以风险对冲为目的，对所投资的资产组合进行风险管理。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。

同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。

10、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标及风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易

保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

(4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(8) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(10) 本基金参与股指期货和国债期货交易的，应当遵守下列要求：

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

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，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持

有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（11）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

（12）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投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资，法律法规另有规定的，从其规定；

（13）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方开展逆回购交易的，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；

（14）本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列投资比例限制：本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品，不得持有合约类信用衍生品，持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的 100%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 3 个月内进行调整；

（15）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；

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

(17) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(18) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的从其规定；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(7)、(12)、(13)、(14)、(18) 项规定的情形外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更以后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须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限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为恒指港股通指数收益率（经汇率调整）。

本基金是指数基金，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因此选取恒指港股通指数收益率作为业绩比较基准，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

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

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

但若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准并及时在规定媒介上公告。

七、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征相似。

本基金投资于港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

第十二部分 基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十三部分 基金资产估值

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、股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、信用衍生品、其它投资等资产及负债。

三、估值原则

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

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

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

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

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

整并确定公允价值。

四、估值方法

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

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

3、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定。

4、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。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。

5、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券，选取估值日收盘价作为估值全价。实行净价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

6、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，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。

7、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。

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

9、本基金持有的国债期货合约，一般以国债期货合约估值日的结算价估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

10、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及《企业会计准则》要求采用合理估值技术确定公允价值。

11、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。

12、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，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。

13、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计提利息。

14、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，无需召开基金份额持有人大会。

15、对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

16、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。

本基金应当按法律法规及监管机构发布的最新金融工具相关会计准则规定进行资产分类以及会计核算。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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。

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净值信息的计算结果对外予以公布。

五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接经济损失按下述“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，通知基金托管人，并报中国证监会备案。

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

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净

值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 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、指数编制单位或登记机构等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十四部分 基金的收益与分配

一、基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为现金分红；

3、当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率计算方法如下：基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算日或拆分、合并日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算日或拆分、合并日为初始日重新计算）；

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要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。

二、收益分配方案

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

三、收益分配方案的确定、公告与实施

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

四、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

第十五部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货/期权交易、结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、基金登记费用、IOPV 计算与发布费用；
- 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”），及基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 13、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 14、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—14 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、本基金的指数许可使用费；

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

第十六部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

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

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

第十七部分 基金的信息披露

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

二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资人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人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人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载基金合同

生效公告。

（四）基金净值信息

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

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

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

（五）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后至少应提前 2 个工作日将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应在 3 个工作日内将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

（六）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3 个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

（七）申购赎回清单

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

（八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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

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

（九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、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、登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基

金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、本基金停牌、复牌或终止上市交易；

21、本基金推出新业务或服务；

22、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

23、发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

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和基金合同约定的其他事项。

（十）澄清公告

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

（十一）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出

清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（十二）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十三）参与国债期货交易的信息披露

本基金参与国债期货交易的，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。

（十四）参与股指期货交易的信息披露

本基金参与股指期货交易的，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、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交易政策和交易目标等。

（十五）投资股票期权的信息披露

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

（十六）投资信用衍生品的信息披露

本基金投资信用衍生品的，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响，以及是否符合既定的投资目标及策略。

（十七）投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，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。

（十八）投资非公开发行股票的相关公告

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

（十九）参与融资业务的信息披露

本基金参与融资业务的，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况等。

（二十）参与转融通证券出借业务的信息披露

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

（二十一）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。

（二十二）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关

基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- （1）不可抗力；
- （2）发生基金暂停估值的情形；
- （3）法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

第十八部分 风险揭示

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征相似。

本基金投资于港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、本基金特有风险、流动性风险、其他风险及本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

一、市场风险

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

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

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

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

风险，但不能完全规避。

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

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

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

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

二、基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。

2、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误，或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门，导致基金利益的直接损失。

3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障或瘫痪等情况而无法完成基金的申购、赎回、注册登记、清算交收等指令而产生的操作风险，或者由于操作过程效率低下或人为疏忽和错误而产生的操作风险。

4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

三、本基金特有的风险

1、标的指数回报与证券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个证券市场。标的指数成份股的平均回报率与整个证券市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

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

3、标的指数值计算出错的风险

尽管指数公司将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

4、标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

5、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

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

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

（3）成份股票派发现金红利、成份股票增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

（4）由于标的指数中债券是每天将利息进行再投资的，而组合债券利息收入

只在卖券时和债券付息时才收到利息部分的现金，然后才可能进行这部分资金的再投资，因此在利息再投资方面可能会导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。另外，指数成份债券在付息时，根据法律法规，持有人需缴纳利息税，因此实际收到的利息金额将低于票面利息金额，相应的，利息再投资收益也较全额票面利息降低，该两方面差异也进一步导致基金收益率偏离标的指数收益率和加大跟踪误差偏离度。

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

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

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

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

6、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

7、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险

未来，基金管理人可以计算或委托其他机构计算并发布基金份额参考净值，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值与实时的基金份额净值可能存在差异，基金份额参考净值计算可能出现错误，投资人若参考基金份额参考净值进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

8、申购、赎回风险

(1) 本基金目前采用现金申购赎回，投资人的申购、赎回价格依据招募说明

书约定的代理买卖原则确定，可能受组合证券的买卖价格、汇率等的影响，与申请当日的基金份额净值或有不同，投资人须承担其中的交易费用、汇率波动和冲击成本，也可能因买卖期间的市场波动遭遇损失。

(2) 申购、赎回失败风险。申购时，如果投资人未能提供符合要求的申购对价，申购申请可能失败。赎回时，如果投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能按要求准备足额的现金，赎回申请可能失败。基金还可能在申购赎回清单中设定申购份额上限（或赎回份额上限），

如果投资人的申购（或赎回）申请接受后将使当日申购（或赎回）总份额超过申购份额上限（或赎回份额上限），则投资人的申购（或赎回）申请可能失败。此外，如果申购赎回代理机构交收资金不足，登记机构将按照投资人申报时间先后顺序逐笔检查申购赎回代理机构的资金是否足额并相应确认申购份额，对于后申购的投资人，不论是否备足资金，都可能面临申购失败的风险。

(3) 投资人在赎回时，因个别证券出现停牌等原因导致基金管理人无法在短期内卖出证券，从而导致赎回周期较长的风险。

(4) 当发生不可抗力、证券交易所临时停市或其他异常情况时，本基金可能暂停办理赎回，投资人面临无法及时赎回的风险。

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

9、申购赎回清单差错风险

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

10、申购赎回清单标识设置风险

基金管理人在进行申购赎回清单的现金替代标识设置时，将充分考虑由此引发的市场套利等行为对基金持有人可能造成的利益损害。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回清单标识设置的完全合理性。

11、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）申购赎回代理机构因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。

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

（3）证券交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

12、基金退市风险

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

13、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品等金融衍生品交易风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

（1）股指期货交易风险

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

（2）股票期权交易风险

股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

（3）国债期货交易风险

本基金参与国债期货交易，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，主要包括：利率波动原因造成的市场价格风险、宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、市场和资金流动性原因引起的流动性风险、交易制度不完善而引发的制度性风险等。

（4）信用衍生品投资风险

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品。信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

①流动性风险

信用衍生品在交易转让过程中因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将信用衍生品以合理价格变现的风险。

②偿付风险

在信用衍生品存续期间，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。

③价格波动风险

由于创设机构或所受保护的债券主体经营状况或利率环境发生变化，引起信用衍生品价格出现波动的风险。

14、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

15、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临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。

16、转融通证券出借风险

第一，流动性风险，本基金参与转融通证券出借业务后，当出现大额赎回时，基金将面临因为无法变现资产而无法应对赎回的风险。

第二，信用风险，本基金参与转融通证券出借业务可能会面临证券出借对手方到期不能归还所借证券，或不能补偿相应权益或费用的风险。

第三，市场风险，本基金参与转融通证券出借业务后，可能面临无法及时处置证券的市场风险。

17、指数编制机构停止服务的风险

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

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

18、成份股停牌的风险

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

（1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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

(3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

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

19、港股通投资风险

本基金的投资范围为包括港股通，因此本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

(1) 市场联动的风险

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

(2) 股价波动的风险

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

(3) 汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元

对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

（4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

（5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

（6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形。

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

如在内地市场开市而香港市场休市的情形下，港股通也不能正常交易，本基金所持港股将不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险等。

（7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资

金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因,本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账,而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险,同时也存在不能及时调整基金资产组合中 A 股和港股投资比例,造成比例超标的风险。

(8) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

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

本基金存在因上述规则,利益得不到最大化甚至受损的风险。

(9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定,在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时,上市公司方可采取停牌措施。此外,不同于内地 A 股市场的停牌制度,联交所对停牌的具体时长并没有量化规定,只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则;同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如,ST 及*ST 等标记)以警示投资者风险的做法不同,在香港联交所市场没有风险警示板,联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权,使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

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

(10) 港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资,受港股通规则的限制和影响;本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

(11) 其他可能的风险

除上述显著风险外,本基金参与港股通投资,还可能面临的其他风险,包括但

不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

四、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现在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人赎回对价的风险。

1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为开放式基金，投资人可以在本基金的申购、赎回开放日申请申购或赎回本基金。但在极端的、特殊的市场情况下可能无法满足投资人的日常申购及赎回申请。

本基金为被动投资指数基金。在投资方向与投资比例方面，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，与此同时，本基金严格控制流通受限基金、流通受限资产的投资比例。本基金为 ETF，不同于其他的开放式基金采用现金赎回的方式，其赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价，这将降低本基金因应对日常赎回的需要而变现基金资产的压力。但在极端的、

特殊的市场情况下，若证券投资基金行业普遍面临流动性风险，本基金所投资的证券投资基金的流动性风险也将一定程度上影响本基金的应对赎回能力。

2、暂停基金估值

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基金估值，基金份额持有人将面临无法及时赎回所持有的基金份额的风险。

五、其他风险

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

六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

第十九部分 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，并依据法律法规规定报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、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；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、

勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

第二十部分 基金合同的内容摘要

《基金合同》的内容摘要见附件一。

第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

《托管协议》的内容摘要见附件一。

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。基金管理人承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

一、客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）

1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金净值查询、账户信息查询、基金管理人信息查询、基金信息查询等。

2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至每周五，9：00～17：00 的人工电话咨询服务。

3、客户留言服务

投资人可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知基金管理人客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

二、订制对账单服务

投资者可以通过基金管理人客户服务电话、电子邮箱、传真、信件等方式订制对账单服务，基金管理人在准确获得投资者邮寄地址、手机号码及电子邮箱的前提下，将为已订制账单服务的投资者提供电子邮件、短信和纸质对账单：

1、电子邮件对账单

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。基金管理人在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的持有人发送电子对账单。

2、短信对账单

短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。基金管理人在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信

对账单服务的持有人发送短信对账单。

3、纸质对账单

如投资者因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服热线 400-81-95533（免长途话费）按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，将 15 个工作日内为投资者免费邮寄纸质对账单。

三、网站服务（www.ccbfund.cn）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、基金管理人动态及相关信息等。

2、账户查询：投资人可通过网上“账户查询”服务查询账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资人还可通过“账户查询修改”、“查询密码修改”自助修改基本信息及查询密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷地下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好地了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资人的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

四、短信服务

若投资人准确完整地预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资人可拨打客服电话或登陆基金管理人网站添加后定制此项服务。

五、电子邮件服务

若投资者准确完整的预留了电子邮箱地址，可获得免费电子邮件服务，包括产品信息、公司最新公告等。未预留电子邮箱地址的投资者可拨打客服电话或登录基金管理人网站添加后订制此项服务。

六、微信

基金管理人通过官方微信即时通讯服务平台为投资者提供理财资讯及基金信息查询等服务。投资者可在微信中搜索“建信基金”或者“ccbfund”添加关注。

投资者通过基金管理人官方微信可查询基金净值、产品信息、分红信息、理财资讯等内容。已开立建信基金账户的投资者，将微信账号与基金账号绑定后可查询基金份额、交易明细等信息。

七、密码解锁/重置服务

为保证投资人账户信息安全，当拨打客服电话或登陆基金管理人网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达 6 次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

八、客户建议、投诉处理

投资人可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信、传真等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

九、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。

第二十三部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的的内容与格式进行披露，并至少在一种规定媒介上公告。

第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十五部分 备查文件

- 1、中国证监会准予建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- 2、《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集注册建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、注册登记协议

8、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

附件一 《基金合同》内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资人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，基金投资人自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项、申购对价、赎回对价及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 按照反洗钱法律法规要求，向基金管理人和基金销售机构提供身份基本信息及相关证明文件，配合基金管理人和基金销售机构就反洗钱事项进行尽职调查；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 发售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，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人的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- (10) 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务规则；
- (17) 根据反洗钱法律法规要求，针对基金份额持有人较高洗钱风险情形，采取强化措施（包括对基金份额持有人的相关账户及交易加强监测、管控等措施），管理和降低风险；
- (18) 根据《个人信息保护法》和反洗钱相关法律法规要求，收集、存储、使用、加工、传输、提供、公开、删除等方式处理基金份额持有人个人信息及反洗钱信息，并为基金托管人依法开展的反洗钱工作提供充分的协助；
- (19) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证

所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

（17）确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人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) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

(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，为基金办理证券交易等资金清算；

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照基金合同及托管协议的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同及托管协议的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同及托管协议规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律

法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和基金合同及托管协议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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数

为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）召开事由

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

- （1）终止基金合同，基金合同另有约定的除外；
- （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）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；

(14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率；

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

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；

(6) 调整基金的申购赎回方式；调整申购对价、赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(7) 基金管理人履行适当程序后，推出新业务或服务；

(8) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(9) 调整基金收益分配原则；

(10) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。参加

基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

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

议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

(八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规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本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并依据法律法规规定报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、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；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期

限。

四、争议的处理

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，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，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不含香港、澳门特别行政区法律和台湾地区的有关规定）管辖并从其解释。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

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

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

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

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

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

附件二 《托管协议》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：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：生柳荣

成立日期：2005年9月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、中国证监会证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期限：持续经营

联系电话：010-66228888

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：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

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下列投资运作进行监督：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

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

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行

适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2、对基金投融资比例进行监督；

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

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

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

(4)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

(8)本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(9)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

(10)本基金参与股指期货和国债期货交易的，应当遵守下列要求：

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

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，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；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%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，以符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

（11）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（12）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投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资，法律法规另有规定的，从其规定；

（13）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方开展逆回购交易的，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；

（14）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；

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

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

（17）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场

波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的从其规定；

(18) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(7)、(12)、(13)、(17)项规定的情形外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更以后的规定为准。

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须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限制，如适用于本基金，基金管理

人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

（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、相关信息披露及基金宣传推介材料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上述约定，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、本协议的规定，应当视情况暂缓或拒绝执行，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、本协议规定的，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，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、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和证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，分账管理，独立核算，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）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

（三）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。

（四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

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

（五）基金证券账户、结算备付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。

（六）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和资金结算专户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

（七）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。

（八）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，保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致并加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

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、基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值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位以内（含第4位）发生错误时，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，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通知基金托管人并报中国证监会备案；当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，通知基金托管人，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担和基金托管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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制单位或登记机构等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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

（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；《基金合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点。基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。《基金合同》生效不足两个月的，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。

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供给基金托管人复核，基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人；基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。基金托管人在复核过程中，

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

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金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中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

（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、澳门特别行政区法律和台湾地区有关规定）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。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（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。

（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。