

银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数
证券投资基金招募说明书

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2026年3月20日证监许可【2026】555号文准予募集注册。

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风险和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票型证券投资基金、混合型证券投资基金、债券型证券投资基金、货币市场基金、基金中基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金按照基金份额发售面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额发售面值。

本基金主要投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、基金运作风险、本基金的特有风险、流动性风险、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及其他风险等。本基金为交易型开放式基金，特定风险包括：指数化投资的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金交易价格与基金份额净值发生偏离的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、基金份额赎回对价的变现风险、退市风险、

终止基金合同风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、第三方机构服务的风险、投资股指期货的风险、投资资产支持证券的风险、投资股票期权风险、参与融资交易的风险、参与转融通证券出借业务的风险、投资存托凭证的风险、参与债券回购的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数不符合要求或指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、标的指数变更的风险及投资科创板股票的风险。

因本基金不再符合上海证券交易所上市条件被终止上市，或者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，本基金将终止基金合同并进行基金财产清算。故基金份额持有人可能面临基金合同终止的风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能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，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，具体风险揭示详见本基金招募说明书。

本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，了解本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、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得可能会高于或低于投资人先前所支付的金额。投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主

做出投资决策，自行承担投资风险。投资人应当认真阅读并完全理解基金合同第二十二部分规定的免责条款、第二十三部分规定的争议处理方式。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或其他销售机构认购、申购和赎回基金份额，基金销售机构名单详见本招募说明书、本基金的基金份额发售公告以及相关披露。

本基金标的指数为上证科创板芯片设计主题指数，标的指数的编制方法如下：

1、指数名称和代码

指数名称：上证科创板芯片设计主题指数

指数简称：科创芯片设计

英文名称：SSE STAR Chip Design Thematic Index

英文简称：STAR Chip Design

指数代码：950162

2、基日与基点

该指数以 2019 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

3、样本选取方法

（1）样本空间

指数样本空间由满足以下条件的科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成：

①上市时间超过 6 个月，除非上市以来日均总市值排名在科创板市场前 5 位且上市时间超过 3 个月；

②非退市风险警示证券。

（2）可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

（3）选样方法

①对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取主营业务涉及芯片设计领域的上市公司证券作为待选样本；

②对待选样本按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本；当待选样本数量不足 50 只时，将待选样本全部纳入。

4、指数计算

指数计算公式为：

报告期指数=（报告期样本的调整市值/除数）*1000

其中，调整市值= \sum （证券价格×调整股本数×权重因子）。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

5、指数样本和权重调整

（1）定期调整

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

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

投资人可以通过中证指数有限公司官网（www.csindex.com.cn）免费查询指数信息。

目 录

一、绪言	6
二、释义	7
三、基金管理人	13
四、基金托管人	28
五、相关服务机构	32
六、基金的募集	34
七、基金合同的生效	43
八、基金份额折算与变更登记	45
九、基金份额的上市交易	46
十、基金份额的申购与赎回	48
十一、基金的投资	60
十二、基金的财产	69
十三、基金资产估值	70
十四、基金的收益与分配	77
十五、基金的费用与税收	79
十六、基金的会计和审计	82
十七、基金的信息披露	83
十八、风险揭示	91
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	102
二十、基金合同的内容摘要	104
二十一、基金托管协议的内容摘要	122
二十二、对基金份额持有人的服务	140
二十三、其他应披露事项	141
二十四、招募说明书的存放及查阅方式	142
二十五、备查文件	143

一、绪言

《银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《银华上证科创板芯片设计主题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”）及其他有关法律法规编写。

本招募说明书阐述了银华上证科创板芯片设计主题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。

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。本招募说明书由银华基金管理股份有限公司解释。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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。基金合同当事人应按照《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。

二、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：指银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人：指银华基金管理股份有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《银华上证科创板芯片设计主题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《银华上证科创板芯片设计主题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《银华上证科创板芯片设计主题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《银华上证科创板芯片设计主题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《银华上证科创板芯片设计主题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《银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》

10、上市交易公告书提示性公告：指《银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告》

11、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

12、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国

国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

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

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

17、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 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

18、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”（Exchange Traded Fund）

19、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，跟踪同一标的指数，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金

20、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

21、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

22、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

23、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

24、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

25、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，经中国证监会批准，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

26、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

27、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得本基金基金份额的投资人

28、基金销售业务：指基金管理人或其他销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回等业务

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

30、基金销售网点：指销售机构的销售网点

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

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

33、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》（及其不时修订）定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

34、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

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

36、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

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

- 38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 39、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 40、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 41、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数
- 42、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 43、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 44、《业务规则》或业务规则：指银华基金管理股份有限公司、上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及后续修订的业务规则
- 45、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本基金基金份额的行为
- 46、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定，以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人购买本基金基金份额的行为
- 47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件，要求将基金份额兑换为申购赎回清单所规定的赎回对价的行为
- 48、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
- 49、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
- 50、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
- 51、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的上证科创板芯片设计主题指数
- 52、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
- 53、最小申购赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍
- 54、现金替代：指申购或赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
- 55、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小

申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

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

57、元：指人民币元

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

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

60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

61、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

62、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

63、基金份额参考净值：指基金管理人或者基金管理人委托其他机构根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

64、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，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额及基金份额净值，并由登记机构进行基金份额变更登记的行为

65、基金的转托管：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

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

67、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，则以基金份额折算或拆分、合并日为初始日重新计算）

68、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，

则以基金份额折算或拆分、合并日为初始日重新计算)

69、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

70、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

71、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

72、转融通证券出借业务：指本基金以一定费率，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

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称	银华基金管理股份有限公司		
住所	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦19层		
办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层		
法定代表人	王珠林	成立日期	2001年5月28日
批准设立机关	中国证监会	批准设立文号	中国证监会证监基金字[2001]7号
组织形式	股份有限公司	注册资本	2.222亿元人民币
存续期间	持续经营	联系人	兰健
电话	010-58163000	传真	010-58163090

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7号文）设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2.222亿元人民币，公司的股权结构为西南证券股份有限公司（出资比例44.10%）、第一创业证券股份有限公司（出资比例26.10%）、东北证券股份有限公司（出资比例18.90%）、山西海鑫实业有限公司（出资比例0.90%）、珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）（出资比例3.57%）、珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）（出资比例3.20%）及珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）（出资比例3.22%）。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“战略委员会”、“风险控制委员会”、“薪酬与提名委员会”、“审计委员会”四个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置权益投资管理部、多元策略投资管理部、固定收益投资管理部、养老金及多资产投资管理部、

量化投资部、境外投资部、FOF 投资管理部、研究部、产品开发与管理部、营销管理与服务部、渠道业务总部、机构业务总部、养老金业务总部、券商业务总部、交易管理部、风险管理部、运作保障部、信息技术部、互联网金融部、战略发展部、投资银行部、基础设施投资部、监察稽核部、内部审计部、党委办公室（党群工作部）、人力资源部、公司办公室、财务行政部、深圳管理部等职能部门，并设有北京分公司、上海分公司两家分公司，以及银华长安资本管理（北京）有限公司、深圳银华永泰创新投资有限公司和银华国际资本管理有限公司三家全资子公司。此外，公司设立投资决策委员会作为公司投资业务的最高决策机构，同时下设“主动型股票投资决策、固定收益投资决策、量化和境外投资决策、养老金投资决策、基金中基金投资决策、基金投资顾问投资决策、基础设施基金投资决策”七个专门委员会。公司投资决策委员会负责确定公司投资业务理念、投资政策及投资决策流程和风险管理。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事及其他高级管理人员

王珠林先生：董事长，经济学博士。曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师，甘肃省证券公司发行部经理，中国蓝星化学工业总公司处长，蓝星清洗股份有限公司董事、副总经理、董事会秘书，西南证券副总裁，中国银河证券副总裁，西南证券董事、总裁；还曾先后担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、中国证券业协会投资银行业委员会委员、重庆市证券期货业协会会长、中国证券业协会绿色证券专业委员会副主任委员、中证机构间报价系统股份有限公司董事。现任公司董事长，兼任银华国际资本管理有限公司董事长、银华长安资本管理（北京）有限公司董事、中国上市公司协会并购融资委员会执行主任、中国证券业协会证券行业文化建设委员会顾问、深圳证券交易所理事会创业板股票发行规范委员会委员。

王芳女士：董事，法学硕士、清华五道口金融 EMBA。曾任大鹏证券有限责任公司法律支持部经理，第一创业证券有限责任公司首席律师、法律合规部总经理、合规总监、副总裁，第一创业证券股份有限公司副总裁、合规总监、常务副总裁。现任第一创业证券股份有限公司董事、总裁，第一创业证券承销保荐有限责任公司执行董事，深圳第一创业创新资本管理有限公司董事。

李福春先生：董事，中共党员，硕士研究生，高级工程师。曾任一汽集团公司发展部部长；吉林省经济贸易委员会副主任；吉林省发展和改革委员会副主任；长春市副市长；吉林省发展和改革委员会主任；吉林省政府党组成员、秘书长。现任东北证券股份有限公司党委委员、董事长，东证融汇证券资产管理有限公司董事，银华基金管理股份有限公司董事，中国证券业协会第八届理事会理事，深圳证券交易所第六届理事会战略发展委员会委员，上海证券交易所第六届理事会政策咨询委员会委员，吉林省证券业协会会长。

赵天才先生：董事，计算机硕士、工商管理硕士。曾任西南大学图书馆系统管理员，重庆有价证券公司营业部系统管理员，西南证券有限责任公司重庆胜利路证券营业部交易主管、徐州淮海西路证券营业部业务总监、风险管理部总经理助理、合规与风险管理部总经理助理，西南证券股份有限公司合规与风险管理部总经理助理、风险控制部副总经理、风险控制部总经理、职工监事、合规部总经理、风险控制部总经理，西证股权投资有限公司董事、西证创新投资有限公司董事。现任西南证券股份有限公司合规总监、首席风险官。

王立新先生：经济学博士，曾任职于中国工商银行总行、中国农村发展信托投资公司、南方证券股份有限公司、南方基金管理有限公司。现任银华基金管理股份有限公司董事、总经理，银华长安资本管理（北京）有限公司董事长，银华国际资本管理有限公司董事，银华基金投资决策委员会主任，兼任中国基金业协会兼职副会长。

张兴桥先生：中共党员，研究生学历。曾任职于长春市驻京办、民政局等部门，现任银华基金管理股份有限公司职工代表董事、党委副书记、纪委书记，兼任深圳市银华公益基金会理事。

郑秉文先生：独立董事，经济学博士，教授，博士生导师。曾任中国社会科学院研究生院副院长，欧洲所副所长，拉美所所长和美国所所长，第十三届全国政协委员。现任中国社科院世界社保研究中心主任，中国社会科学院社会保障实验室首席专家，中国社科院大学政府管理学院教授、博士生导师，政府特殊津贴享受者，人力资源和社会保障部咨询专家委员会委员，在北京大学、中国人民大学、国家行政学院、武汉大学等十几所大学担任客座教授。

封和平先生：独立董事，会计学硕士，中国注册会计师。曾任职于财政部所

属中华财务会计咨询公司，并历任安达信华强会计师事务所副总经理、合伙人，普华永道会计师事务所合伙人、北京主管合伙人，摩根士丹利中国区副主席；还曾担任中国证监会发行审核委员会委员、中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员、第 29 届奥运会北京奥组委财务顾问。现任北京水滴科技集团有限公司独立董事、金科地产集团股份有限公司独立董事。

李伟东先生：独立董事，法学博士。曾担任平安证券股份有限公司、华泰期货有限公司、福建海西金融租赁有限公司、深圳市美盈森集团股份有限公司、海控南海发展股份有限公司、深圳市联建光电股份有限公司、深圳市朗科科技股份有限公司独立董事职务。现任广东海派律师事务所主任，全面负责律师事务所管理，兼任中国国际经济贸易仲裁委员会和深圳国际仲裁院（华南国际经济贸易仲裁院）仲裁员、平潭综合试验区海峡两岸仲裁委员会仲裁员，以及陆金所控股、深圳市盐田港股份有限公司、远航港口发展有限公司、中国中药控股有限公司、深圳市英唐智能控制股份有限公司等上市公司独立董事职务。

徐波先生：副总经理，北京大学工商管理硕士。自 2002 年起，先后任职于全国社会保障基金理事会、中国文化产业投资母基金管理有限公司。现任公司副总经理、投资决策委员会副主任。

凌宇翔先生：副总经理，工商管理硕士。曾任职于机械工业部、西南证券有限责任公司。2001 年起任银华基金管理有限公司督察长。现任公司副总经理。

周毅先生：副总经理，CFA，硕士学位，国家特聘专家。现任银华基金副总经理、银华国际资本总经理，分管指数基金投资、数量化投资、境外投资及国际业务。周毅先生毕业于中国北京大学、美国南卡罗莱纳大学、美国约翰霍普金斯大学，拥有 23 年证券从业经验。回国加入银华基金前，先后在美国普华永道金融部，巴克莱资本，巴克莱亚太集团等金融机构从事数量化投资工作。

杨文辉先生：督察长，法学博士。曾任职于北京市水利经济发展有限公司、中国证监会。现任银华基金管理股份有限公司督察长，兼任银华长安资本管理（北京）有限公司董事、银华国际资本管理有限公司董事，深圳市银华公益基金会理事长。

苏薪茗先生：副总经理，博士研究生，获得中国政法大学法学学士、清华大学法律硕士、英国剑桥大学哲学硕士、中国社会科学院研究生院经济学博士（金

融学专业) 学位。曾先后担任福建日报社要闻采访部记者, 中国银监会政策法规部创新处主任科员, 中国银监会创新监管部综合处副处长, 中国银监会创新监管部产品创新处处长, 中国银监会湖北银监局副局长。现任公司副总经理、银华长安资本管理(北京)有限公司董事、银华国际资本管理有限公司董事。

邓列军先生: 首席信息官, 清华大学软件工程硕士。曾在汇添富基金管理股份有限公司先后任职信息技术部总监助理、副总监、总监, 浦银安盛基金管理有限公司任职副总经理兼首席信息官。现任银华基金管理股份有限公司首席信息官。

郑蓓雷女士: 财务负责人, 工商管理硕士。曾就职于中国贸促会北京分会、搜狐公司、中国网通公司、西南证券、红塔证券。2011年6月加入银华基金, 历任人力资源部副总监、总监、总经理助理。现任公司财务负责人兼人力资源部总监。

王勇先生: 董事会秘书, 管理学博士。曾任职于西南证券股份有限公司。现任公司董事会秘书、投资银行部总监、党委办公室(党群工作部)主任、公司办公室副总监, 兼任银华国际资本管理有限公司董事、副总经理, 银华长安资本管理(北京)有限公司监事、深圳银华永泰创新投资有限公司监事。

2、本基金拟任基金经理

张亦驰先生, 硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015年10月加入银华基金, 历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理, 现任量化投资部基金经理。自2021年5月25日至2023年9月27日担任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金、银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2021年5月25日至2024年8月28日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2021年5月25日至2024年4月25日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理, 自2021年11月23日起兼任银华华证ESG领先指数证券投资基金基金经理, 自2022年6月20日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2022年6月20日至2023年9月27日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2022年11月21日起兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自2022年11月21

日至2024年7月16日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年11月21日至2023年12月19日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年4月7日至2024年7月16日兼任银华中证500价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年7月11日起兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年9月6日起兼任银华上证科创板100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年12月1日起兼任银华中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年12月4日起兼任银华上证科创板100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2023年12月20日至2025年12月10日兼任银华创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年3月6日起兼任银华中证A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年4月25日起兼任银华中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年5月6日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年5月22日起兼任银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年8月23日起兼任银华中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2024年12月3日起兼任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2025年9月17日起兼任银华中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2025年11月11日起兼任银华创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

3、公司投资决策委员会成员

委员会主任：王立新

委员会副主任：徐波

委员：周毅、王华、李晓星、吴伟、于蕾、董岚枫、杨宇、倪明

王立新先生：详见主要人员情况。

徐波先生：详见主要人员情况。

周毅先生：详见主要人员情况。

王华先生：高级董事总经理，经济学硕士。曾就职于西南证券有限责任公司。2000年10月加入银华基金（筹），历任基金经理、总经理助理，现任公司业务

副总经理、主动型股票投资决策专门委员会联席主任、A股基金投资总监、多元策略投资管理部总监、社保和基本养老组合投资经理、投资经理。

李晓星先生：北京理工大学学士、英国帝国理工大学工程硕士、英国剑桥大学工学硕士。曾就职于ABB（中国）有限公司。2011年3月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、投资管理部基金经理助理、投资管理一部基金经理，现任公司业务副总经理、权益投资管理部投资总监、基金经理、投资经理（社保基本养老保险）、主动型股票投资决策专门委员会联席主任。

吴伟先生：金融学硕士。曾先后担任中国银行北京市分行副科长、卢森堡分行副经理，中国民生银行资产管理部副总经理、民生理财有限责任公司副总裁等职务。现任公司业务副总经理。

于蕾女士：业务副总经理，经济学硕士。曾就职于中国人寿资产管理有限公司、中国人寿养老保险股份有限公司。2024年4月加入银华基金管理股份有限公司，现任公司业务副总经理、养老金及多资产投资管理部总监、FOF投资管理部总监。

董岚枫先生：清华大学工学学士、硕士、博士。曾就职于中国五矿集团。2010年10月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、行业研究员、研究组长、研究部总监助理、副总监、总监、总经理助理，现任公司业务副总经理兼研究部总监。

杨宇先生：中央财经大学经济学硕士。历任CCTV证券资讯频道主持人、制片人，新浪仓石基金销售有限公司高级基金研究员，北京恒天明泽基金销售有限公司研究产品部经理，银华基金电子商务部高级经理，华宝证券首席财富官。现任公司基金投资顾问投资决策专门委员会主任、资产配置与投顾服务委员会办公室主任。

倪明先生：经济学博士。曾在大成基金管理有限公司从事研究分析工作，历任债券信用分析师、债券基金助理、行业研究员、股票基金助理等职，并曾任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司，曾任投资管理一部副总监兼基金经理。现任研究部副总监。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包

括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律的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的规定，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、更换销售机构，对销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- (10) 依据基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券/期货所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；若本基金采用证券经纪机构交易结算模式，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪机构，并签订证券经纪服务协议；
- (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、赎回等业务规则；
- (17) 基金管理人有权根据反洗钱法律法规的相关规定，结合基金份额持有

人洗钱风险状况，采取相应合理的控制措施；

(18) 在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整基金费率结构和收费方式；

(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/期货投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、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法律法规或监管机构另有规定或要求外，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、司法机关提供或因审计、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, 保存期限不低于法律法规的规定;

(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内发出, 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前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 基金合同不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期活期存款利息(税后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人, 募集期间网下股票认购所冻结的股票应予以解冻;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（四）基金管理人承诺

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

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

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- （2）动用银行信贷资金从事证券买卖；
- （3）违反规定将基金资产向他人贷款或者提供担保；
- （4）从事证券信用交易（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；
- （5）以基金资产进行房地产投资；
- （6）从事有可能使基金承担无限责任的投资；
- （7）从事证券承销行为；
- （8）违反证券交易业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；
- （9）进行高位接盘、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为；
- （10）通过股票投资取得对上市公司的控制权；
- （11）因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法利益；
- （12）法律、法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

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

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

(5) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

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

(7) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着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) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、声誉风险和外部风险。针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在什么样的风险，为什么会存在以及如何引起风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低的风险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时适时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、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，主要通过对其工作流程的控制，进而达到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风险控制委员会，负责针对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究并制定相应的控制制度。在特殊情况下，风险控制委员会可依据其职权，在上报董事会的同时，对公司业务进行一定的干预。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有

效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。

此外，公司设有督察长，组织指导公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性进行全面检查与监督，发生重大合规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，指定人员进行处理。

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监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合法合规性。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具合规报告，报公司督察长、董事会及中国证监会。

(3) 基金管理人关于内部控制制度的声明

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) 上述关于内部控制制度的披露真实、准确;
- 3) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人不断发展完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：Bank of Communications Co., Ltd.

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：8836378.422300 万人民币

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：方圆

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 17 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 168 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2025 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 15.50 万亿元。2025 年前三季度，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 699.94 亿元。

交通银行总行设资产托管部/资产托管业务发展中心（下文简称“托管部/托管发展中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任交通银行董事长，2018 年 8 月起任交通银行执行董事。曾任交通银行副董事长、执行董事、行长。曾任中国银行执行董事、副行长，期间曾兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，中国银行上海人民币交易业务总部总裁。曾任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

张宝江先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

张先生 2024 年 8 月起任交通银行副董事长、执行董事，2024 年 6 月起任交通银行行长；曾任中国农业发展银行副行长，安徽省分行行长，总行办公室主任，陕西省分行副行长，总行政策研究室副主任（主持工作）、办公室副主任、研究室副主任等职务。张先生 1998 年于中央党校研究生院获经济学硕士学位，2004 年于中央党校研究生院获经济学博士学位。

孟羽先生，资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

孟先生 2025 年 9 月起任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。曾任交通银行香港分行行政总裁，交通银行（香港）有限公司副董事长、执行董事、行政总裁，交银国际控股有限公司执行董事、首席执行官，广东省分行副行长，营业部副总经理，深圳分行国际业务部高级经理。曾在中国工商银行十堰分行工作。孟先生 1999 年于复旦大学获工商管理硕士学位。

3、基金托管业务经营情况

截至 2025 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 892 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转国有资本充实社保基金、养老保障管理产品、企业年金基金、职业年金基金、企业年金养老金产品、商业养老金产品、期货公司资产管理计划、QFI 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP、债券“南向通”等产品。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部

管理，托管部/托管发展中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

2、内部控制原则

(1) 合法性原则：托管部/托管发展中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

(2) 全面性原则：托管部/托管发展中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、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，建立全面的风险管理监督机制。

(3) 独立性原则：托管部/托管发展中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

(4) 制衡性原则：托管部/托管发展中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(5) 有效性原则：托管部/托管发展中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

(6) 效益性原则：托管部/托管发展中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部/托管发展中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管

理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部/托管发展中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、网下现金及网下股票发售直销机构

银华基金管理股份有限公司北京直销中心

地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼3层		
电话	010-58162950	传真	010-58162951
联系人	展璐		

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。

4、网下股票发售代理机构详见基金份额发售公告。

5、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定，调整销售机构并在基金管理人网站公示。

（二）登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
注册地址	北京市西城区太平桥大街17号		
办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	于文强	联系人	赵亦清
电话	010-50938782	传真	010-50938991

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称	上海源泰律师事务所		
住所及办公地址	上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	021-51150298	传真	021-51150398
经办律师	刘佳、姜亚萍		

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所及办公地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1		

	至 1001-26		
执行事务合伙人	刘维、肖厚发	联系人	陈玉珊
电话	010-66001391	传真	010-66001392
经办注册会计师	陈熹、陈玉珊		

六、基金的募集

（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》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，经中国证监会 2026 年 3 月 20 日证监许可【2026】555 号文准予募集注册。

（二）基金类别、基金的运作方式、标的指数、基金存续期限、基金份额发售面值及认购价格

基金类别：股票型证券投资基金

基金的运作方式：交易型开放式

标的指数：上证科创板芯片设计主题指数

基金存续期限：不定期

基金份额发售面值和认购价格：本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，本基金认购价格为人民币 1.00 元/份。

（三）募集方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资人通过发售代理机构（为上海证券交易所会员）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和/或其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构以股票进行认购。

基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请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。

（四）募集场所

投资人应当在基金管理人及其指定的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，请参见本基金基金份额发售公告。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告或在基金管理人网站公示，基金管理人可以根据情况调整销售机构，并在基金管理人网站上公示。

（五）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金自 2026 年 6 月 1 日至 2026 年 6 月 12 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七部分第（一）条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况，在符合相关法律法规的情况下，在募集期限内调整基金发售时间（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时公告。

（六）募集对象

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

（七）基金的最低募集份额总额和金额

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

基金管理人可根据基金发售情况对本基金的发售进行规模控制，具体规定见本基金的基金份额发售公告或基金管理人发布的其他公告。

若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。

（八）认购开户

1、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“上海证券交易所证券投资基金账户”）。

尚无上海 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户的投资者，需在认购前到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海 A 股账户和上海证券交易所证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

2、如投资人需新开立上海 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户，则应注意：

（1）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。

如投资人需要参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

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

3、如投资人已开立上海 A 股账户或上海证券投资基金账户，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前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(九) 认购费用或认购佣金

本基金的认购采用份额认购的原则。认购佣金由通过发售代理机构认购基金份额的投资人承担，认购佣金比率不超过0.30%，认购费率如下表所示：

	认购份额 (S)	认购费率
认购费率	$S < 100$ 万份	0.30%
	$S \geq 100$ 万份	按笔收取，1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

(十) 网上现金认购

1、认购时间

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

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、认购金额和利息折算的份额的计算公式为：

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(若适用固定费用，认购佣金 = 固定费用)

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

(若适用固定费用, 认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

利息折算的份额=认购金额产生的利息/认购价格

净认购份额=认购份额+利息折算的份额

认购佣金由发售代理机构向投资人收取, 投资人需以现金方式交纳认购佣金。

网上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, 网上现金认购的利息和具体份额以登记机构的记录为准。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。

例1: 某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购1,000份本基金, 假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.30%, 假设认购资金募集期间产生的利息为2.00元, 则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下:

认购佣金=1.00×1,000×0.30%=3.00元

认购金额=1.00×1,000×(1+0.30%)=1,003.00元

利息折算的份额=2/1.00=2份

净认购份额=1,000+2=1,002份

即投资人需准备1,003.00元资金, 方可认购到1,000份本基金基金份额, 加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到1,002份基金份额。

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份或其整数倍并须遵循销售机构的相关规定。投资人可以多次认购, 但需符合法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

4、认购申请

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

投资者提交的认购申请, 由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

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

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

（1）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，不收取认购费用，认购金额和利息折算的份额的计算公式为：

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额}$$

$$\text{利息折算的份额} = \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} + \text{利息折算的份额}$$

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，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。

例2：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，不收取认购费用，假设认购资金募集期间产生的利息为10.00元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 = 100,000 \text{元}$$

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

$$\text{净认购份额} = 100,000 + 10 = 100,010 \text{份}$$

即投资人需准备100,000元资金，方可认购到100,000份本基金基金份额，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到100,010份基金份额。

（2）通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额和利息折算的份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和利息折算的份额的计算。

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份或其整数倍并须遵循销售机构的相关规定；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10万份以上（含10万份），超过部分须为1万份的整数倍。投资人可以多次认购，但需符合法律法

规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

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，由基金管理人于T+2日内进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将汇总的认购款项及其利息划往托管专户。通过基金管理人提交的网下现金认购款项在募集期内产生的利息将折算为基金份额归投资人所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，根据登记机构相关规定进行有效认购款项的清算交收。

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。

（十二）网下股票认购

1、认购时间

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、认购限额

网下股票认购以单只股票股数申报。投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资人应以上海A股账户认购。用于认购的股票必须是符合要求的标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单详见基金份额发售公告）。投资人可以多次提交认购申请，但需符合法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3、认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到基金销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请一经确认不得撤销。

4、特殊情形

(1) 限制个股认购规模：基金管理人可对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前按规定公告限制认购规模的个股名单。

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

如果投资者的个股认购规模超过该股票在标的指数的构成比例，基金管理人有权对超过构成比例的部分予以拒绝。

(3) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

5、清算交收

T日日终（T日为本基金募集期最后一日），发售代理机构将股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资人认购股票进行冻结。基金管理人为投资人计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算佣金。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购佣金，并从投资人的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记，并根据基金管理人确认的认购申请股票数据，按照交易所和登记机构的规则和流程，最终将投资人申请认购的股票过户到本基金在上海证券交易所开立的证券账户。

6、认购份额的计算公式

认购份额=

$$\sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} * \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

1) i代表投资人提交认购申请的第i只股票，n代表投资人提交的股票总只数。如投资人仅提交了1只股票的申请，则n=1。

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

最近一个交易日的均价作为计算价格。

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

①除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价－每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

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

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

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

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

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

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

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

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

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

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

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

7、特别提示：投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

（十三）募集资金利息及募集股票权益的处理

1、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。

2、网上现金认购与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，其中由利息所转的份额以基金管理人或登记机构的记录为准。

3、投资人以股票认购的，按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结，该股票自认购日至登记机构进行股票过户前的冻结期间所产生的权益归属依据相关规则办理。

4、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）设立联接基金或增设新的基金份额类别等相关业务

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，履行适当程序后，募集并管理以本基金为目标ETF的一只或多只联接基金，或为本基金增设新的基金份额类别或者调整基金份额类别设置，或开通场外申购、赎回等相关业务并制定、公布相应的规则等，无须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人可就增设后的全部或部分基金份额申请上市，并制定、公布相应的申购、赎回等交易的规则，而无需召开基金份额持有人大会审议。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

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

2、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。

3、基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购所募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金及股票的处理方式

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（税后）。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

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

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 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，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利或根据需要（如变更标的指数），本基金可以进行份额折算。

（一）基金份额折算的时间

基金管理人可以根据运作情况决定是否对基金份额进行折算并提前公告，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

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

（二）基金份额折算的原则

如未来本基金增加基金份额的类别，基金管理人在实施份额折算时，可对全部份额类别进行折算，也可根据需要只对其中部分类别的份额进行折算。基金管理人将采取措施确保各类别基金份额的平等权利，具体处理措施以届时公告为准。

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。基金份额折算的比例和具体方法和安排本基金管理人将在份额折算公告中列示。

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。除因尾数处理而可能产生的损益外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性不利影响。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。

九、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《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、本基金场内基金资产净值不低于 2 亿元；
- 2、本基金场内基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、法律法规及上海证券交易所规定的其他条件。

（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

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

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 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。

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将根据基金合同第二十一部分的约定终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

（四）基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

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

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 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，本基金将相应调整。

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的计算方法，并予以公告。

(五) 相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或登记机构对基金份额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，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为本基金增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会。

(七) 在不违反法律法规且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，本基金在履行适当程序后可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

(八) 法律法规、监管部门或上海证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。

十、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

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

基金管理人在开始办理申购、赎回业务前公示申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加、减少或变更申购赎回代理券商，并在基金管理人网站上公示。

在法律法规、基金合同及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。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现不可抗力、新的证券/期货交易市场，证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应依照《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

基金管理人可以根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

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

在确定申购开始或赎回开始时间后，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或赎回的开始时间。

本基金可在上市交易之前开始办理申购、赎回，若其后申请基金份额上市，在基金份额申请上市期间，基金可暂停办理申购、赎回业务，具体安排和相关公告中规定。

（三）申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、申购、赎回应遵守上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定。
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待。
- 6、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在对基金份额持有人无实质性不利影响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规则，但应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，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。

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

2、申购和赎回申请的确认

正常情况下，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，则申购申请不成立。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，则赎回申请不成立。

申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到申购、赎回申请。申购与赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人可通过其办理申购、赎回的销售网点或以申购赎回代理券商规定的其他方式及时查询，并妥善行使合法权

利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、申购赎回代理券商不承担由此造成的损失或不利后果。如因申请未得到登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。

投资人申购的基金份额当日起可卖出。投资人赎回获得的股票当日起可卖出。

3、申购和赎回的清算交收与登记

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

对于本基金申购赎回业务涉及的基金份额、上海证券交易所上市的成份股及其现金替代采用净额结算；对于本基金申购赎回业务涉及的现金差额采用代收代付。

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《业务规则》和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代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。

如相关证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则或新增设相关规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（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。本基金最小申购赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购赎回清单。基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求，在法律法规允许的情况下，调整最小申购赎回单位。

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，具体规定请参见相关公告、申购赎回清单或招募说明书更新。

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人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、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述规定申购和赎回的数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金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。基金申购、赎回开放日（T日）的基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。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组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

3、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.3%

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。

4、若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，或因实际情况需要，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下对申购对价、赎回对价组成、基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率进行调整并按规定公告。

（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内各成份证券数据、现金替代、T 日现金替代的溢价比例、T 日允许现金替代的最高比例、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。如上海证券交易所修改或更新申购赎回清单的内容、参数计算方法并适用于本基金的，则按照新的规则执行。

2、申购赎回清单组合证券相关内容

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、最小申购赎回单位

最小申购赎回单位是基金申购赎回的最基本单位。

4、申购赎回清单现金替代相关内容

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部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代的类型

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

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

1) 适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券，或基金管理人认为可以采用现金替代的其他情形。

2) 替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

其中，“该证券参考价格”是指该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取申购现金替代溢价的原因是，对于使用可以现金替代的证券，基金管理人需随后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

3) 替代金额的处理程序

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

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作。

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

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个

交易日) 期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动, 则进行相应调整。

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

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

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

(3) 必须现金替代

1) 适用情形: 必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整, 即将被剔除的成份证券, 或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

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

5、预估现金部分相关内容

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

本基金 T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为:

T 日预估现金部分 = T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和)

其中, T 日预计开盘价主要根据标的指数许可方提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外, 若 T 日为基金分红除息日, 则计算公式中的“T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

6、申购赎回清单现金差额相关内容

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：

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

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。

7、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	XXXX-XX-XX
基金名称	银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	银华基金管理股份有限公司
基金代码	XXXXX

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	XXXX. XX
最小申购、赎回单位净值（单位：元）	XXXX. XX
基金份额净值（单位：元）	X. XXXX

T 日信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分（单位：元）	XXXX. XX
现金替代比例上限	XX%
当日累计可申购的基金份额上限	XX
当日累计可赎回的基金份额上限	XX
当日净申购的基金份额上限	XX

当日净赎回的基金份额上限	XX
单个证券账户当日净申购的基金份额上限	XX
单个证券账户当日净赎回的基金份额上限	XX
单个证券账户当日累计可申购的基金份额上限	XX
单个证券账户当日累计可赎回的基金份额上限	XX
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	XX
申购赎回的允许情况	申购和赎回皆允许

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

申购赎回清单的具体内容与格式以上海证券交易所届时规定为准。基金管理人有权根据业务需要及交易所规则的调整对申购赎回清单的格式进行修改。

（八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
- 3、证券/期货交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理基金的申购业务或者无法进行证券交易。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金管理人可根据市场情况及法律法规、交易所规则要求或基金合同约定在申购赎回清单中设置申购份额或申购比例上限，如果一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申请份额超过申购赎回清单中规定的申购份额或申购比例上限时，该笔申购申请将被拒绝。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或证券市

场价格发生大幅波动，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。

7、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、基金管理人、基金托管人、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制机构、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。

8、基金管理人开市前因异常情况无法编制或未公布申购赎回清单或开市后发现申购赎回清单编制错误或开市后发现基金份额参考净值计算错误。

9、在发生标的指数成份股上市公司重大行为、成份股市场价格异常波动等情形时。

10、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

11、法律法规规定或中国证监会、上海证券交易所认定的其他情形。

发生上述除第4项、第5项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请的措施。

3、证券/期货交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理基金的赎回业务或者无法进行证券交易。

4、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。

5、遵循基金份额持有人利益优先原则，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。

6、因成份股临时停牌或跌停等因素导致不能代卖出而使得赎回现金替代不能按时交收而需要暂停赎回的情形。

7、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

8、法律法规规定或中国证监会、上海证券交易所认定的其他情形。

发生上述除第4项以外的情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）其他申购、赎回方式

1、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，开通本基金的场外申购、赎回业务，调整基金申购赎回方式或申购、赎回对价组成，并按规定公告。

2、在履行适当程序后，本基金可接受投资者以一只或多只成份股或备选成份股进行集合申购，在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定相关规则。具体以基金管理人届时公告为准。

3、如法律法规、监管机构或业务规则以后允许新的申购、赎回方式，基金管理人可开放新的申购、赎回方式，相关适用条件、业务办理时间、业务规则、原则、费用等相关事项按规定予以公告。

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

5、对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》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，安排专门的申购赎回方式，并按规定公告。

（十一）基金的转托管、非交易过户、冻结和解冻等其他业务

基金登记机构可依据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

（十二）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基金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。

（十三）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。

在本基金开放日常申购赎回前，联接基金可以用现金特殊申购本基金基金份额，申购价格以特殊申购日的基金份额净值为基准计算，不收取申购费用。

（十四）基金清算交收与登记模式的调整或新增

基金合同生效后，若上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式指数证券投资基金修改现有的清算交收与登记模式或推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式或调整现有的清算交收与登记模式，履行适当程序后，本基金管理人可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或在本基金的基金合同和/或招募说明书（更新）中予以更新，无需召开基金份额持有人大会审议。

（十五）在不违反相关法律法规规定和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前提下，基金管理人可以在履行相关程序后，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者办理基金份额质押等相关业务，届时须提前公告。

十一、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证，下同）。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含科创板股票、主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）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）。

本基金可以根据相关法律法规，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，其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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合约、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、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规或中国证监会变更相关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或按变更后的规定执行。

（三）投资策略

1、股票投资策略

（1）指数化投资策略

本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。

在本基金运作过程中，如本基金标的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做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先的原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。

建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因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和跟踪误差进一步扩大。

（2）存托凭证投资策略

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

2、金融衍生工具投资策略

为提高投资效率，使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，更好地实现本基金的投资目标，本基金可投资于股票期权、股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融衍生工具。

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

而更好地跟踪标的指数。

基金参与股票期权交易,应当按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的。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。

3、债券投资策略

本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素的基础上,构建债券投资组合。本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略等多种策略进行债券投资。在保持久期匹配的情况下,尽可能提高闲置资金的收益率。

4、可转换公司债券(含分离交易可转换公司债券)及可交换债券的投资策略

可转换公司债券等投资品种通过赋予债券投资者某种期权的形式,兼具债券属性与权益属性,风险收益特征更加独特,相应的投资策略灵活多样。本基金将充分利用该类投资品种的特性,研究挖掘其投资价值,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、行业特征及公司治理等因素;权益价值方面通过对可转换公司债券所对应个股的价值分析,包括估值水平、盈利能力及预期等。此外,还需结合对含权条款的研究,以衍生品量化视角综合判断内含的期权价值。

可交换债券与可转换公司债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票,而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有债券属性和权益属性,其中债券属性与可转换公司债券相同,即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息;而对于权益属性的分析则需关注目标公司的股票价值以及发行人作为股东的换股意愿等。本基金将通过对目标公司股票的投资价值、可交换债券的债券价值、以及条款带来的期权价值等综合分析,进行投资决策。

5、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本

金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

6、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎性原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。本基金在参与融资业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模。本基金管理人将充分考虑融资业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，力争提高基金的投资收益。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况及出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、证券出借平均剩余期限和出借证券在基金资产中的占比。

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（3）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；

（4）本基金总资产不超过净资产的 140%；

（5）本基金参与股指期货交易，需遵循以下投资比例限制：

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

等；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%；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；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%；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

（10）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（11）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%；

（12）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1）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纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2）参与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 30%；

3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

(13) 本基金参与股票期权交易, 需遵守下列投资比例限制:

因未平仓的股票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%; 开仓卖出认购股票期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽股票期权的, 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股票期权保证金的现金等价物; 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(14) 本基金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;

(15) 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 (8)、(9)、(10)、(12) 项情形之外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整或价格变化、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, 基金管理人应当在可调整之日起 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第 (12) 项规定的, 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。

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

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的, 基金管理人在履行适当程序后, 可相应调整投资比例限制规定或按变更后的规定执行, 不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

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

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

法律、行政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按变更后的规定执行。

(五) 标的指数和业绩比较基准

1、标的指数

本基金标的指数为上证科创板芯片设计主题指数。

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

若标的指数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，基金管理人应与基金托管人协商一致后，在规定媒介上公告。

2、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为上证科创板芯片设计主题指数收益率。

（1）业绩比较基准设定的原因

本基金为股票型 ETF，主要采用完全复制法跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证科创板芯片设计主题指数，相应选取上证科创板芯片设计主题指数作为基准要素，同时将上证科创板芯片设计主题指数的基准要素权重设置为 100%。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

（2）业绩比较基准要素的基本信息

上证科创板芯片设计主题指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 950162，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

（3）业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。

（4）管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

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的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，本基金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。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围的，本基金将采取合理措施避免跟踪误差过大。

（5）未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

本基金的业绩比较基准与标的指数一致，相关变更情形和程序详见基金合同“基金的投资”章节“五、标的指数和业绩比较基准”项下“1、标的指数”部分内容。

若本基金调整业绩比较基准的要素权重，本基金将根据法律法规、中国证监会的规定和基金合同约定履行相关程序。

（六）风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市

场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

（七）基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构和销售机构的财产，并由基金托管人、证券经纪机构保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构、证券经纪机构和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、证券经纪机构因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货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、股指期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、资产支持证券、应收款项、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。

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

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

（四）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂

牌的市价（收盘价）估值；估值日无市价的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且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，确定公允价值；

（2）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理（下同）。对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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。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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

（3）交易所上市交易的公开发行的可转换公司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。估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

（4）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。

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、配股和公开增发的股票，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）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股

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

（4）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其公允价值。

3、对全国银行间市场已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理（下同）。对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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。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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按其所处的市场分别估值。

5、本基金持有的回购以摊余成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、本基金持有的银行存款和备付金余额以摊余成本列示，按相应利率逐日计提利息。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价，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。

8、本基金投资股票期权合约，一般以估值当日股票期权结算价进行估值，估值当日无结算价，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、本基金参与融资和转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协

会的相关规定进行估值。

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算、基金份额净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人计算的基金净值信息的结果按规定对外予以公布。若基金托管人已提出合理意见而基金管理人未采纳的，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（五）估值程序

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

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

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，由基金管理人按约定对外公布。

（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。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值计算错误造成投资人或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的投资人或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分

不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

基金托管人发现基金份额净值估值出现重大错误或者估值出现重大偏离的，应当提示基金管理人依法履行披露和报告义务。

(七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货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、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金资产净值、基金份额净值的确认

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份额净值予以公布。

（九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司、证券/期货经纪机构、指数编制机构、存款银行、第三方估值基准服务机构等第三方机构发送的数据错误、遗漏，有关会计制度、市场规则变化等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误、遗漏的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十四、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采取现金分红方式；

3、本基金在基金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进行计算，计算方法如下所示：

基金份额净值增长率 = $(\text{基金份额净值} \div \text{基金上市前一日基金份额净值} - 1) \times 100\%$ （期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算；期间如发生基金份额拆分，则以基金份额拆分日为初始日重新计算）；

标的指数同期增长率 = $(\text{标的指数收盘值} \div \text{基金上市前一日标的指数收盘值} - 1) \times 100\%$ （期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算；期间如发生基金份额拆分，则以基金份额拆分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、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基

金管理人可酌情调整以上基金收益分配原则和支付方式,并于变更实施日前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

十五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费、仲裁费等费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货、股票期权等投资标的的交易结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费用及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、证券、期货账户开户费、银行账户维护费；
- 10、收益分配中发生的费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生所有与清算相关的合理费用，按实际支出额从基金剩余财产中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具划款指令，支付时间及收款账户信息由基金管理人通过书面形式另行通知托管

人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具划款指令，支付时间由基金管理人通过书面形式另行通知托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。基金综合费用水平请参见产品资料概要等文件。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

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

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣

缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十六、基金的会计和审计

（一）基金会计政策

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

法律法规或监管部门对基金会计政策另有规定的，从其规定。

（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。

十七、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过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：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资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。

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

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披

露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

3、《基金合同》生效公告

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

4、基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且本基金未上市交易的，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。

在本基金上市交易后或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交易/开放日的次日，通过规定网站、销售机构网站或者营业网点披露交易/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。

5、基金份额上市交易公告书及其提示性公告

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

6、基金份额申购、赎回对价公告

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

7、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，通过规定网站以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

8、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人持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资人的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、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。

9、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，并提前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，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应依照《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、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、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) 基金份额净值估值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) 基金变更标的指数；
- (20) 基金份额停牌、复牌或终止上市；
- (21) 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；
- (22) 调整基金份额类别的设置；
- (23) 基金推出新业务或服务；
- (24) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

(25) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定或基金合同约定的其他事项。

11、澄清公告

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

12、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

13、清算报告

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

14、投资股指期货相关公告

本基金投资股指期货的，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。

15、投资资产支持证券相关公告

本基金投资资产支持证券的，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。

16、投资股票期权相关公告

本基金投资股票期权的，基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资

政策和投资目标。

17、参与融资、转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与融资及转融通证券出借业务的，基金管理人应当在季度报告、中期报告和年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资及转融通证券出借交易情况，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

18、投资流通受限证券的相关公告

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

19、中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

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

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

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

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

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

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基

金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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

（七）信息披露文件的存放与查阅

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

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、不可抗力；
- 3、发生暂停估值的情形；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

十八、风险揭示

（一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，证券价格受整体政治、经济、社会等环境因素的影响会产生波动，从而对本基金的投资产生潜在风险，导致本基金的收益水平发生波动。

1、政策风险

政策风险是指国家货币政策、财政政策、产业政策等宏观经济政策发生重大变化而导致的本基金投资对象的价格波动，从而给投资人带来的风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，市场的收益水平随经济运行的周期性变动而变动，本基金所投资的权益类和/或债券类投资工具的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。利率不仅直接影响着债券的价格和收益率，还影响着企业的融资成本和利润。基金投资于权益类和/或债券类相关投资工具，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4、购买力风险

基金的一部分收益将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而给投资人带来实际收益水平下降的风险。

5、再投资风险

市场利率下降将影响债券利息收入的再投资收益率。

6、债券发行人提前兑付风险

当利率下降时，拥有提前兑付权的债券发行人往往会行使该类权利。在此情形下，基金经理不得不将兑付资金再投资到收益率更低的债券上，从而影响投资组合的整体回报率。

7、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

8、信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

9、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

10、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

（二）基金运作风险

1、管理风险

在本基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响本基金收益水平。此外，基金管理人的职业操守和道德标准同样都有可能对本基金回报带来负面影响。因此，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

2、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等导致本基金资产损失，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等。

在基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、银行间债券市场、证券/期货交易所、证券登记机构、中央国债登记结算有限责任公司等等。

（三）其他风险

1、技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金的认购、申购、赎回无法按正常时限完成、登记系统瘫痪、核算系

统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险；

2、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、基金托管人违约等超出本基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致本基金或者基金份额持有人的利益受损；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失；

4、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；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

6、本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式，即本基金参与证券交易所场内投资部分将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易，并由选定的证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易和结算模式可能增加本基金投资运作过程中的信息系统风险、操作风险、交易指令传输和资金使用效率降低的风险、无法完成当日估值的风险、交易结算风险、基金投资非公开信息泄露的风险等；

7、其他意外导致的风险。

（四）本基金的特定风险

1、指数化投资的风险

在建仓完成后，本基金不低于 90% 的基金资产净值将用于跟踪标的指数，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2、标的指数波动的风险

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

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、部分成份股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误

差。

4、基金交易价格与基金份额净值发生偏离的风险

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供求关系等诸多因素影响，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。

5、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托其他机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并由上海证券交易所交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算也可能出现错误，投资人若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需由投资人自行承担。

6、基金份额赎回对价的变现风险

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

7、退市风险

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

8、终止基金合同风险

因本基金不再符合上海证券交易所上市条件被终止上市，或者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，则本基金将终止基金合同，并按照基金合同约定程序进行清算，基金份额持有人将面临无法继续投资本基金的风险。

9、投资人申购失败的风险

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

10、投资人赎回失败的风险

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资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。

11、套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和 ETF 存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

12、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、现金替代比例、替代金额等出错，将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。

13、二级市场流动性风险

对 ETF 基金而言，二级市场流动性风险是指由于相关成份股的市场流动性不足使基金无法以合理价格买入或卖出所需股份数量所造成的风险。流动性风险主要发生在基金建仓期以及标的指数调整成份股期间。

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

14、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

(2) 登记机构可能调整结算制度，如对投资人基金份额、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理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 第三方机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

15、投资股指期货的风险

本基金可投资股指期货，可能面临的风险包括但不限于：

(1) 基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。

(2) 保证金风险

产品的期货头寸，如果未预留足够现金，在市场出现极端情况时，可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险。

(3) 合约展期风险

组合持有的主力合约交割日临近，需要更换合约进行展期，如果合约的基差朝不利的方向变化或流动性不足，展期会面临风险。

16、投资资产支持证券的风险

本基金可投资资产支持证券，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。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

17、投资股票期权风险

本基金可投资股票期权，可能面临的风险包括但不限于：

(1) 流动性风险

由于股票期权合约众多，交易较为分散，股票期权市场的流动性一般较期货市场要低，尤其是深度实值和虚值的股票期权，成交量稀少，持有这些股票期权的投资者容易遇到无法成交、平仓出局的局面。

(2) 价格风险

股票期权买方的价格风险即为他所付出的权利金，风险具有确定性。股票期权卖方的价格风险不定，不过其所收取的权利金可以提供相应保护，当发生亏损时，可以抵消部分损失。

(3) 操作风险

操作风险是指由于管理不善或者制度执行出现问题等原因所导致的风险。股

票期权作为一种衍生工具，虽然可以用来管理风险，但若使用不当，也会产生巨额损失。

18、参与融资交易的风险

本基金可参与融资交易，可能面临的风险包括但不限于：

（1）杠杆效应放大风险

本基金通过融资可以扩大交易额度，利用较少资本来获取较大利润，这必然也放大了风险。本基金将股票作为担保品进行融资时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担新投资股票带来的风险，还得支付相应的利息或费用，如判断失误或操作不当，会加大亏损。

（2）担保能力及限制交易风险

单只或全部证券被暂停融资、投资相关账户被暂停或取消融资或融券资格等，这些影响可能给本基金造成经济损失。此外，本基金也可能面临由于维持担保比例低于融资合同约定的担保要求，且未能及时补充担保物，导致信用账户交易受到限制，从而造成经济损失。

（3）强制平仓风险

本基金在从事融资交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动，导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险，由此可能给本基金造成经济损失。

19、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，可能面临的风险包括但不限于：

（1）流动性风险：面临大额赎回时可能因证券出借原因发生无法及时变现，从而无法支付赎回对价的风险。

（2）信用风险：面临证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

20、投资存托凭证的风险

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

险。

21、参与债券回购的风险

本基金的投资范围包括债券回购，债券回购为提升基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。若本基金参与债券回购，如发生债券回购交收违约，质押券可能面临被处置的风险，因处置价格、数量、时间等的不确定，可能会给基金资产造成损失。

22、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。但是，标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、部分成份股流动性差等原因可能使本基金无法及时调整投资组合，极端情况下可能发生跟踪误差控制未达约定目标的风险。

23、标的指数不符合要求或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。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）、指数编制机构退出的情形，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，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。

24、成份股停牌的风险

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，当标的指数成份股停牌或发生明显负面事件面临退市时，可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

25、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，在履行适当程序后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和成本。

26、投资科创板股票的风险

（1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，其后涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

（2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险。

（3）信用风险

科创板实行注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

（4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

（5）系统性风险

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

（6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大

影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（五）流动性风险

1、基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资人可能面临暂停赎回、延缓支付赎回对价、基金估值被暂停等风险。投资人应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险匹配。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金属于跟踪上证科创板芯片设计主题指数的交易型开放式指数证券投资基金，上证科创板芯片设计主题指数从科创板上市公司证券中选取 50 只市值较大且主营业务涉及芯片设计领域的上市公司证券作为指数样本，反映科创板芯片设计领域上市公司证券的整体表现。该指数整体流动性较好，因此在正常市场环境下本基金的流动性风险较低。但在特殊情况下，本基金仍可能出现流动性不足的情况，基金管理人将根据不同的情况采取相应的流动性风险管理措施，防范风险。

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对基金投资人潜在影响

（1）暂停接受赎回申请

具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形及处理方式”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。在此情形下，基金投资人可能会面临赎回效率降低的风险。

（2）延缓支付赎回对价

具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回对价的情形及程序。在此情形下，投资人接收赎回对价的时间将可能比一般正常情形下有所延迟，申请赎回的基金份额持有人不能如期获得全额赎回对价，除了对自身流动性产生影响外，也可能将损失延迟对价部分的再投资收益。

（3）暂停基金估值

具体请参见基金合同“第十六部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的

情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。在此情形下，投资人面临暂时无法获取基金净值信息的风险，没有可供参考的基金净值信息，同时赎回申请可能被暂停接受，或被延缓支付赎回对价。

（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其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，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。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。若法律法规发生变化，则以变化后的规定为准。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：基金合同终止事由出现后，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

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

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告，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，保存期限不少于法律法规的规定。

二十、基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律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、更换销售机构，对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/期货所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为

基金提供服务的外部机构；若本基金采用证券经纪机构交易结算模式，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪机构，并签订证券经纪服务协议；

(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、赎回等业务规则；

(17) 基金管理人有权根据反洗钱法律法规的相关规定，结合基金份额持有人洗钱风险状况，采取相应合理的控制措施；

(18) 在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整基金费率结构和收费方式；

(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/期货投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、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法律法规或监管机构另有规定或要求外，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、司法机关提供或因审计、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，保存期限不低于法律法规的规定；
- (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前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其

他法律行为；

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息(税后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人,募集期间网下股票认购所冻结的股票应予以解冻;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《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》、《托管协议》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、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；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规的规定；

(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，保存期限不低于法律法规的规定；

(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》、《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业监督管理机构，并通知基金管理人；

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

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，即成为本基金的基金份额持有人和《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。

本基金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、基金产品资料概要等信息披露文件；
- (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) 交纳基金认购款项或股票、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 向基金管理人和监管机构提供依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
- (10) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (11) 遵守中华人民共和国反洗钱法律法规，配合基金管理人、基金托管人履行反洗钱职责；
- (12) 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。

(四) 基金管理人、基金托管人简况涉及基本信息更新的，将在招募说明书中更新，基金管理人、基金托管人简况以招募说明书（更新）中披露的信息为准。

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本基金的基金份额持有人和本基金联接基金（如有）的基金份额持有人组成，上述两类基金份额持有人可以参会并表决或委托其合法授权代表参会并表决。本基金的基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

若以本基金为目标基金且基金管理人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，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基金份额持有人大会。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

（一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，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：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；

- (3) 更换基金托管人；
 - (4) 转换基金运作方式；
 - (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
 - (6) 变更基金类别；
 - (7) 本基金与其他基金的合并；
 - (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
 - (9) 变更基金份额持有人大会程序；
 - (10) 终止基金上市，但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除外；
 - (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
 - (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
 - (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
 - (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、在法律法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、变更收费方式；
 - (3) 因相应的法律法规、中国证监会、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则或行业自律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重大变化；
 - (5) 基金推出新业务或服务；
 - (6) 调整或开通新的基金的申购赎回方式，调整申购对价、赎回对价组成、申购赎回清单的内容或申购赎回清单计算和公告时间或频率；
 - (7) 调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；

(8) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(9) 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、表决意见提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，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人

持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式（包括书面、网络、电话、短信或其他方式）进行表决，基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知载明的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

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的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的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、在不违反法律法规或监管机构规定的情况下，经会议通知载明，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。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在不违反法律法规或监管机构规定的情况下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，召集人接受的具体授权方式在会议通知中列明。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在基金份额持有人大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为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和代理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异义，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》的有关规定在规定媒介上公告。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人履行适当程序后，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、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

(一) 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。若法律法规发生变化，则以变化后的规定为准。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：基金合同终止事由出现后，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告，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，保存期限不少于法律法规的规定。

四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，基金管理人和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约定的义务，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，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

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。

二十一、基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人（或称“管理人”）

名称：银华基金管理股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦19层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

法定代表人：王珠林

成立时间：2001年5月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字〔2001〕7号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

注册资本：贰亿贰仟贰佰贰拾万元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

（二）基金托管人（或称“托管人”）

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发〔1986〕字第81号文和中国人民银行银发〔1987〕40号文

基金托管资格批文文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

注册资本：8836378.422300万人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本托管协议的约

定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证，下同）。同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含科创板股票、主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）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）。

本基金可以根据相关法律法规，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，其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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合约、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、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规或中国证监会变更相关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或按变更后的规定执行。

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

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 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；

(4) 本基金总资产不超过净资产的140%；

(5) 本基金参与股指期货交易，需遵循以下投资比例限制：

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

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

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

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

(10) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(11) 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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 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纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与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30%；

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

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

(13) 本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

因未平仓的股票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%；开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，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股票期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(14) 本基金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；

(15) 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(8)、(9)、(10)、(12)项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整或价格变化、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，基金管理人应当在可调整之日起10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(12)项规定的，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。

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

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，基金管理人在履行适当

程序后，可相应调整投资比例限制规定或按变更后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 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按变更后的规定执行。

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

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算

的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿，基金托管人应予以必要协助与配合。

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

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

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

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

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

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法

规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准或注册文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

7. 基金托管人对基金参与转融通证券出借业务的监督。

基金参与转融通证券出借业务的,基金管理人应当遵守审慎经营原则,配备技术系统和专业人员,制定科学合理的投资策略和 risk 管理制度,完善业务流程,有效防范和控制风险,基金托管人将对基金参与出借业务进行监督和复核。

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

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担相应责任,并有权在发现后报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时

通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

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、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1. 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运

用、处分、分配基金的任何资产，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

2. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构的固有财产。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人、证券经纪机构固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人、证券经纪机构以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

3. 基金托管人按照规定开立基金财产的银行存款账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户。

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

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

（二）基金募集资产的验证

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

（三）基金的银行存款账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

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

4. 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5. 基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户、证券资金账户的开立和管理

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. 基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

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

4. 由基金托管人持基金管理人与证券经纪机构签订的三方存管相关协议办理证券资金账户与本基金银行存款账户的银证签约手续，未经基金托管人书面同意，基金管理人不得将银证签约的指定银行结算账户（即本基金银行存款账户）变更其他账户，否则，因此引起的法律后果及给本基金造成的相应损失由基金管理人承担。

5. 本基金证券账户和证券资金账户的开立和使用，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未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户和证券资金账户；亦不得使用本基金的证券账户和证券资金账户进行本基金业务以外的活动。

（五）债券托管账户的开立和管理

1. 基金合同生效后，基金管理人负责向中国人民银行进行报备，基金托管人在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金

的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

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

（六）期货相关账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应当按照有关规定设立。

基金托管人已取得期货保证金存管银行资格，基金管理人授权基金托管人办理相关银期转账业务。

（七）基金投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括托管人印章）及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议/存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、存款到期指定收款账户等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

（八）其他账户的开立和管理

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

（九）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

基金托管人只负责对存款证实书进行保管，不负责核对存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

（十）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本托管协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限不低于法律法规的规定。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同复印件或传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

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

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

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，由基金管理人按约定对外公布。

估值原则应符合《基金合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。

本基金按以下方法估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无市价的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且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，确定公允价值；

(2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理（下同）。对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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。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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

(3) 交易所上市交易的公开发行的可转换公司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。估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

(4) 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。

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

(4) 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其公允

价值。

3、对全国银行间市场已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理（下同）。对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取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。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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按其所处的市场分别估值。

5、本基金持有的回购以摊余成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、本基金持有的银行存款和备付金余额以摊余成本列示，按相应利率逐日计提利息。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价，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。

8、本基金投资股票期权合约，一般以估值当日股票期权结算价进行估值，估值当日无结算价，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、本基金参与融资和转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算、基金份额净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果按规定对外予以公布。若基金托管人已提出合理意见而基金管理人未采纳的，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

1. 如采用本托管协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

2. 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

3. 基金管理人、基金托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司、证券/期货经纪机构、指数编制机构、存款银行、第三方估值基准服务机构等第三方机构发送的数据错误、遗漏，有关会计制度、市场规则变化等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误、遗漏的，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。

针对净值差错处理，如果法律法规或中国证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

（三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（四）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、登录和保管本基金的全套账册，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。

（五）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（六）基金报表与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。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报告的编制，应于季度终了后15个工作日内完成；基金招募说明书、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3个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金招募说明书、基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。中期报告在上半年结束后的2个月内公告；年度报告在年度结束后3个月内公告。如果基金合同生效不足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。

基金管理人在月初3个工作日内完成上年度报表的编制，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或以双方约定的其他方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报

告、年度报告、更新招募说明书、基金产品资料概要等，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

基金托管人对上述报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

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低于法律法规的规定。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

双方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，应将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受中华人民共和国法律（为本托管协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

八、基金托管协议的变更、终止

（一）基金托管协议的变更

本托管协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。

(二) 基金托管协议的终止

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

二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修订这些服务项目。

基金管理人提供的主要服务内容如下:

一、咨询服务

投资人如果了解基金公告、基金净值等信息,请拨打银华基金管理股份有限公司客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询。

客户服务中心: 400-678-3333、010-85186558

公司网址: <http://www.yhfund.com.cn>

二、在线服务

基金管理人利用自己的线上平台定期或不定期为基金投资人提供投资咨询及基金经理(或投资顾问)交流服务。

三、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。

二十三、其他应披露事项

无。

二十四、招募说明书的存放及查阅方式

基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将招募说明书置备于公司住所、上海证券交易所，供社会公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

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

二十五、备查文件

1. 中国证监会准予银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
2. 《银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册银华上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的法律意见；
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。

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。