中创400交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书

(2026年11月10日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

中创 400 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2012 年 1 月 6 日中国证券监督管理委员会《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]13 号）和 2012 年 2 月 9 日《关于中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]52 号）的核准进行募集。本基金类型为交易型开放式。本基金基金合同于 2012 年 3 月 22 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本《招募说明书》。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。中创 400 交易型开放式指数证券投资基金被动跟踪标的指数“中创 400 指数”，因此，本基金的业绩表现与中创 400 指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。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，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

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

本基金标的指数为中创400指数。

（1）指数样本空间

在深圳证券交易所原中小企业板和创业板上市交易且满足下列条件的所有A股：

① 非ST、*ST股票；

② 上市时间超过六个月，A股总市值排名位于深圳市场前1%的股票除外；

③ 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；

④ 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；

⑤ 考察期内股价无异常波动。

（2）选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的A股日均总市值和A股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的A股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后10%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的A股日均总市值从高到低排序，选取前100名股票构成中创100指数初始样本股，选取排名在前500名的股票，构成中创500指数初始样本股。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

中创500指数样本股剔除同期中创100指数样本股后剩下400只股票构成中创400指数样本股。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见国证指数网，网址：www.cnindex.com.cn。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书主要更新了基金管理人、基金经理等相关信息，涉及“基金管理人”等章节。

目录

一、绪言 4
二、释义 5
三、基金管理人 11
四、基金托管人 20
五、相关服务机构 24
六、基金的募集 39
七、基金合同的生效 44
八、基金份额的上市交易 45
九、基金份额的申购、赎回 47
十、基金的非交易过户、冻结与解冻 54
十一、基金的投资 54
十二、基金的业绩 65
十三、基金的融资、融券 67
十四、基金的财产 68
十五、基金资产估值 70
十六、基金的收益与分配 74
十七、基金的费用与税收 75
十八、基金的会计与审计 77
十九、基金的信息披露 78
二十、风险揭示 83
二十一、《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算 88
二十二、《基金合同》内容摘要 91
二十三、基金托管协议的内容摘要 104
二十四、对基金份额持有人的服务 114
二十五、其他应披露事项 116
二十六、《招募说明书》存放及查阅方式 117
二十七、备查文件 118

一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<《招募说明书》的内容与格式>》、《公开募集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》”）等有关法律法规以及《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写。

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

本《招募说明书》根据本基金的《基金合同》编写，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。如本《招募说明书》内容与《基金合同》有冲突或不一致之处，均以《基金合同》为准。基金投资者自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和本《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

二、释义

《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

词语或简称	含义
《招募说明书》	《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
《基金合同》	《中创 400 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的修订和补充
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
中国	中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》及有权机关对该法不时修订或更新的版本
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本
《运作办法》	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布，于 2004 年 7 月 1 日起实施并于 2014 年 7 月 7 日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订
《信息披露办法》	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本
《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
深交所《业务细则》	《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》及有权机关对该文件不时修订或更新的版本
交易型开放式指数	《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定

证券投资基金	义的“交易型开放式指数基金”，即是指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易
ETF 联接基金	将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金
元	中国法定货币人民币元
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
基金产品资料概要	《中创 400 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
银行保险监管机构	指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金非直销销售机构	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接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商（代办证券公司）
销售机构	基金管理人及基金非直销销售机构
基金销售网点	基金管理人的直销中心及基金非直销销售机构的销售网点
发售代理机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构
申购赎回代理券商	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，又称为代办证券公司
登记结算业务	《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所的交易型开放式

	基金登记结算业务实施细则》（包括对该文件不时修改或更新的版本）定义的基金份额的登记、托管和结算业务
登记结算机构	办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受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
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
基金份额持有人大会	按照《基金合同》第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议
募集期	《基金合同》和《招募说明书》中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	深圳证券交易所的正常交易日
开放日	申购赎回代理券商办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	办理申购、赎回或其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	在本基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。
赎回	在本基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，申请将其持有的本基金基金份额兑换为《基金合同》约定的对价资产
申购赎回清单	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
申购对价	投资者申购基金份额时，按《基金合同》和《招募说明书》规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
赎回对价	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
标的指数	深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司编制并发布的中创 400 指数及其未来可能发生的变更
组合证券	本基金标的指数所包含的全部或部分证券
完全复制法	一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的
最小申购赎回单位	本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍
现金替代	申购或赎回过程中，投资者按《基金合同》和《招募说明书》的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
现金差额	最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购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
预估现金部分	由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结

基金份额参考净值	深圳证券交易所在交易时间内根据申购赎回清单中的组合证券的实时市值并加计含预估现金部分所计算发布的基金份额参考净值，简称 IOPV
指令	基金管理人在管理基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令
收益评价日	基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日
基金净值增长率	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，则以基金份额折算日为初始日重新计算）
标的指数同期增长率	收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
流动性受限产	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
指定媒介	中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
不可抗力	当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律及政策变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其

	他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

三、基金管理人

（一） 基金管理人概况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层
法定代表人	经雷
成立日期	1999 年 3 月 25 日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司 40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司 30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	罗朝伟

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

（二） 主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安国勇先生，董事长，博士研究生，中共党员。曾任中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁，中诚信托有限责任公司党委书记、总裁。

王会妙女士，董事，北京大学经济学博士。曾就职于河北定州师范学院、国投信托有限责任公司。2011 年 5 月加入中诚信托有限责任公司，曾任信托业务总部业务团队负责人（MD）、信托业务三部总经理、财富管理中心副总经理、资产配置部总经理、中诚资本管理（北京）有限公司总经理等职，现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁。

Markus Johann Kobler先生，董事，瑞士、英国及德国国籍。毕业于瑞士巴塞尔大学（University of Basel），获经济学博士学位。加入DWS Group前，Markus Johann Kobler先生于1993年至2023年期间先后担任学术研究、管理咨询、金融服务及高级管理职务，曾任职于瑞士巴塞尔大学（University of Basel）、麦肯锡公司（McKinsey & Company）、瑞士宝盛银行（Bank Julius Baer & Co. AG）及安联环球投资（Allianz Global Investors）等机构。Markus Johann Kobler先生于2023年11月加入DWS Group，目前担任管理委员会成员（Member of the Management Board）、首席财务官（Chief Financial Officer）及首席财务官部门负责人（Head of the CFO Division）。

沈铠圻（Heidi Sum）女士，董事，中国香港籍，毕业于香港大学，获工学学士学位，并持有特许金融分析师（CFA）资格及英国皇家特许测量师学会会员（MRICS）资格。沈铠圻女士拥有逾二十年亚太及全球资产管理、房地产投资及实物资产投资经验。加入DWS Group前，曾于新鸿基地产发展有限公司、领盛投资管理公司（LaSalle Investment Management）、嘉民集团（Goodman Group）及月桥资本有限公司（Moonbridge Capital）任职，从事房地产投资、私募房地产基金管理及相关投资管理工作。2014年9月加入DWS Group，先后担任亚太区主动股票及流动实物资产产品专家主管、亚太区产品主管等职务，现任董事总经理、全球流动实物资产产品主管。

徐柳女士，董事，伦敦政治经济学院理学硕士、中国人民大学经济学硕士。曾任职于中国国际金融股份有限公司，历任总裁研究助理，投资银行部副总经理、执行总经理、董事总经理职务，期间曾主导多项重大资本运作项目；2024年10月至今，任北京金山办公软件股份有限公司副总裁。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，现任明石创新技术集团股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。现兼任重庆国际信托股份有限公司独立董事、中国人寿养老保险股份有限公司独立董事、赞同科技股份有限公司独立董事、爱美客技术发展股份有限公司董事。

李一军先生，独立董事，工学博士，中共党员。曾任哈尔滨工业大学管理学院助教、讲师，副教授、室主任、副院长，教授、博士导师、院长；德国科隆大学访问教授、美国夏威夷大学访问教授；国家自然科学基金委员会管理科学部常务副主任。现任哈尔滨工业大学经济与管理学院教授、博士导师。

高峰先生，独立董事，中国香港籍，纽约州立大学石溪分校博士。曾先后就职于斯坦福大学美国航天局艾姆斯研究中心（NASA Ames Research Center）、索罗门兄弟公司（Salomon Brothers Inc.）、美国友邦金融产品集团（AIG Financial Products Corp.）。1996年起任职于德意志银行股份有限公司（Deutsche Bank AG），历任纽约分行银行利率交易董事，亚洲区信用产品交易主管，上海分行行长、环球市场部中国区主管、董事总经理。2008年1

月起任职于德意志银行（中国）有限公司（Deutsche Bank (China) Co., Ltd.），历任上海分行行长、环球市场部中国区主管、行长、董事会执行董事、董事长。高峰先生于2020年4月至2024年3月任新锐资产管理有限公司（Sprint Asset Management Limited）董事总经理；2021年3月至今兼任联易融数字科技集团有限公司（Linklogis Inc.）独立董事。

张光耀先生，独立董事，管理学学士学位。曾任普华永道中天会计师事务所高级审计经理，北京天佑投资有限公司投资总监、奥特佳新能源科技有限公司上市公司监事、审计总监、董事及财务总监、采购委员会委员，冠昊生物科技股份有限公司财务总监，北京博奥晶典生物技术有限公司首席财务官。2022年1月至今任恒泰柯半导体（上海）有限公司首席财务官。

经雷先生，董事，总经理，财务负责人，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1998年6月至2008年5月在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部从事研究投资工作；2008年5月至2013年9月，历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人；2013年10月入职嘉实基金管理有限公司，2013年10月至2018年3月任机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月至今任嘉实基金管理有限公司总经理；2018年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

沈树忠先生，监事长，正高级会计师，管理学硕士。曾任中国糖业酒类集团公司财务部科员、财务部副经理、审计部经理、财务部经理、财务总监、副总经理、常务副总经理（主持工作）、法定代表人；曾兼任北京华堂商场有限公司董事、中日合资成都伊藤洋华堂商场有限公司副董事长、酒鬼酒股份有限公司董事。现任中诚信托有限责任公司财务总监。现兼任北京三侨物业管理有限责任公司董事、法定代表人。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管，立信投资有限公司财务总监。现任立信投资有限公司监事。

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006年9月至2010年7月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010年7月至2011年1月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011年1月至2013年11月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监兼董事会办公室主任。

马莲女士，监事，法学博士，中共党员。曾任北京市竞天公诚律师事务所律师，法国基德律师事务所北京代表处法律顾问，北京天驰律师事务所律师、合伙人。2013年9月加入嘉实资本管理有限公司，历任法律合规总监、首席风控官。2020年6月至2025年7月任嘉实财富管理有限公司副总经理、风控合规负责人。现任嘉实基金管理有限公司审计部总监。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

姚志鹏先生，副总经理，硕士研究生。2011年加入嘉实基金管理有限公司，曾任股票研究部研究员、基金经理、成长风格投资总监兼权益投资部总监、股票投研首席投资官，现任公司副总经理。

鲁令飞先生，副总经理，硕士研究生。2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，历任机构业务部机构销售、保险业务部总监、机构销售业务板块负责人，现任公司副总经理、首席市场官。

张敏女士，副总经理，博士研究生。2010年3月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部副总监、总监、首席风险官，现任公司副总经理、养老首席投资官。

刘伟先生，首席信息官，硕士研究生。2010年4月加入嘉实基金管理有限公司，历任信息技术部高级软件工程师、C-Lab科技总监、数字业务部总监，现任公司首席信息官。

张丹华先生，副总经理，博士研究生。2011年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究组研究员、研究部副总监、研究部总监、科技行业投资总监、AI Lab负责人，现任公司副总经理、股票投资首席投资官。

2、投资总监

归凯先生，成长风格投资总监，硕士研究生。曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014年5月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监。

张金涛先生，价值风格投资总监，硕士研究生。曾任中金公司研究部能源组组长，润晖投资高级副总裁负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012年10月加入嘉实基金管理有限公司，曾任海外研究组组长、策略组投资总监。

胡永青先生，投资总监（固收+），硕士研究生。曾任天安保险固定收益组合经理，信诚基金投资经理，国泰基金固定收益部总监助理、基金经理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。

赵国英女士，投资总监（纯债），硕士研究生。曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020年8月加入嘉实基金管理有限公司。

3、基金经理

（1）现任基金经理

徐鹤洋女士，硕士研究生，3年证券从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。2022年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任固收投研体系助理研究员，现任指数投资部分析师。2026年11月7日至今任嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经

理、2026 年 11 月 7 日至今任嘉实中证信息安全主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2026 年 11 月 7 日至今任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2012 年 3 月 22 日至 2014 年 5 月 9 日；何如女士，管理时间为 2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日；刘珈吟女士，管理时间为 2016 年 3 月 24 日至 2021 年 9 月 4 日；李直先生，管理时间为 2019 年 3 月 30 日至 2021 年 9 月 4 日；田光远先生，管理时间为 2021 年 9 月 4 日至 2024 年 2 月 1 日；张超梁先生，管理时间为 2024 年 2 月 1 日至 2026 年 11 月 7 日。

4、指数与量化投资决策委员会

指数与量化投资决策委员会的成员包括：指数与量化投资首席投资官刘斌先生，公司总经理经雷先生，指数投资总监刘珈吟女士，股票研究部总监刘杰先生，风险管理部总监武雪冬先生，指数基金经理李直先生。

5、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三） 管理人职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

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

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

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）向其基金管理人、基金托管人出资；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）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。

4、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

（4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本公司建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。公内部控制制度是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。它由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，包括内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。公司基本管理制度包括内部会计控制制度、风险管理控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核、合规管理、风险控制和紧急应变制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等进行了具体规定。

2、内部控制的原则

（1）健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

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

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

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

3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风控与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、投资总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和工

作流程、组织纪律。合规管理部门具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监控检查工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

（1）公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

（4）公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

（5）公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（7）建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

（8）建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

（9）建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

（10）建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

（11）制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

（12）公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性进行监控核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

5、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人： 廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2025 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 209 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2025 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1512 只。自 2003 年以来，本行连续二十二年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 110 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制 COSO 准则从内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、监督与评价五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新

情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从2005年至今，中国工商银行资产托管部共十八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

1.内部控制目标

（1）资产托管业务经营管理合法合规；

（2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；

（3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；

（4）提高资产托管经营效率和效果；

（5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

2.内部控制的原则

（1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。

（2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

（3）制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

（4）适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

（5）审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

（6）成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

3.内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

（1）总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

（2）总行内控合规部负责指导托管业务的内控管理工作，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中，将全行托管业务纳入内控评价体系。

（3）总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

（4）一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

4.内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在环境、制度、流程、岗位职责、人员、授权、创新、合同、印章、服务质量、收费、反洗钱、防止利益冲突、业务连续性、考核、信息系统等全方面执行内部控制措施。

5.风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理委员会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险和次生风险。

6.业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异城相结合的备份办公场所、必要的工作人员、科学清晰的AB岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异城异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

（五）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金

资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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，基金托管人应报告中国证监会。

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

五、相关服务机构

（一） 基金份额销售机构

1、申购赎回代办券商

(1)国泰海通证券股份有限公司

住所	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
办公地址	上海市静安区南京西路 768 号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
法定代表人	朱健	联系人	黄博铭
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	www.gtht.com	客服电话	95521

(2)中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区光华路 10 号		
注册地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
法定代表人	刘成	联系人	谢欣然
电话	010-86451810		
网址	http://www.csc108.com	客服电话	(8610)65608107

(3)国信证券股份有限公司

住所	广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
办公地址	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦		
注册地址	广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	张纳沙	联系人	李颖
电话	0755-81682519		
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

(4)招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
法定代表人	霍达	联系人	业清扬

电话	0755-82943666	传真	0755-83734343
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	95565

(5)广发证券股份有限公司

住所	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室		
办公地址	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦		
注册地址	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室		
法定代表人	林传辉	联系人	陈姗姗
电话	（020）66338888		
网址	http://www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

(6)中信证券股份有限公司

住所	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座		
办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
注册地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座		
法定代表人	张佑君	联系人	王一通
电话	010-60838888		
网址	http://www.citics.com	客服电话	95548

(7)中国银河证券股份有限公司

住所	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101		
办公地址	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦		
注册地址	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101		
法定代表人	王晟	联系人	辛国政
网址	https://www.chinastock.com.cn	客服电话	4008-888-888 或 95551

(8)海通证券股份有限公司

住所	上海市黄浦区广东路 689 号		
办公地址	上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场		
注册地址	上海市黄浦区广东路 689 号		
法定代表人	李军(代)	联系人	张家瑞
电话	021-23185429	传真	021-63809892

网址	http://www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

(9)申万宏源证券有限公司

住所、办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
法定代表人	张剑	联系人	王昊洋
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

(10)兴业证券股份有限公司

住所、办公地址	福建省福州市湖东路 268 号		
注册地址	福建省福州市湖东路 268 号		
法定代表人	苏军良	联系人	乔琳雪
电话	021-38565547		
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

(11)长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号		
注册地址	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号		
法定代表人	刘正斌	联系人	奚博宇
电话	027-65799999	传真	027-85481900
网址	http://www.95579.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

(12)国投证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦		
法定代表人	王苏望	联系人	彭洁联
电话	0755-81682531		
网址	www.sdicsc.com.cn	客服电话	95517

(13)西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼		
注册地址	重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼		
法定代表人	姜栋林	联系人	冉绪

电话	023-63786145		
网址	http://www.swsc.com.cn	客服电话	95355

(14)华泰证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场		
注册地址	江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场		
法定代表人	王会清	联系人	郭力铭
电话	18936886079		
网址	http://www.htsc.com.cn/	客服电话	95597

(15)山西证券股份有限公司

住所、办公地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
注册地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	王怡里	联系人	郭熠
电话	（0351）8686659	传真	（0351）8686619
网址	http://www.sxzq.net/shouye/index.shtml	客服电话	95573

(16)中信证券（山东）有限责任公司

住所	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
办公地址	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座		
注册地址	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
法定代表人	肖海峰	联系人	赵如意
电话	0532-85725062		
网址	http://sd.citics.com	客服电话	95548

(17)东吴证券股份有限公司

住所	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号		
办公地址	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦		
注册地址	江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号		
法定代表人	范力	联系人	陆晓
电话	0512-52938521	传真	0512-62938527
网址	http://www.dwzq.c	客服电话	95330

	om.cn		

(18)东方证券股份有限公司

住所	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦		
办公地址	中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层		
注册地址	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦		
法定代表人	鲁伟铭(代)	联系人	龚玉君、闻鑫
网址	http://www.dfzq.com.cn	客服电话	021-6332 5888

(19)方正证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717		
办公地址	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座17层		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
网址	http://www.founders.com	客服电话	95571

(20)长城证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层		
注册地址	深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层		
法定代表人	王军	联系人	陈静
电话	0755-8355761		
网址	http://www.cgws.com/cczq	客服电话	95514

(21)光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
注册地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	刘秋明	联系人	郁疆
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	95525

(22)中信证券华南股份有限公司

住所、办公地址	广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室		
注册地址	广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室		
法定代表人	陈可可	联系人	郭杏燕
电话	020-88834787		
网址	http://www.gzs.com.cn	客服电话	95548

(23)南京证券股份有限公司

住所	江苏省南京市江东中路 389 号		
办公地址	江苏省南京市建邺区江东中路 389 号		
注册地址	江苏省南京市江东中路 389 号		
法定代表人	李剑锋	联系人	曹梦媛
电话	025-58519529		
网址	http://www.njzq.com.cn	客服电话	95386

(24)浙商证券股份有限公司

住所、办公地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
注册地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
法定代表人	钱文海	联系人	许嘉行
电话	（0571）87901912	传真	（0571）87901913
网址	http://www.stocke.com.cn	客服电话	95345

(25)平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层		
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层		
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层		
法定代表人	何之江	联系人	王阳
传真	021-58991896		
网址	http://www.stock.pingan.com	客服电话	95511-8

(26)东莞证券股份有限公司

住所	广东省东莞市莞城区可园南路 1 号

办公地址	广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼		
注册地址	广东省东莞市莞城区可园南路 1 号		
法定代表人	潘海标	联系人	梁微
电话	0769-22115712		
网址	http://www.dgzq.com.cn/	客服电话	95328

(27)华西证券股份有限公司

住所、办公地址	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦		
注册地址	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦		
法定代表人	杨炯洋	联系人	赵静静
电话	010-58124967		
网址	http://www.hx168.com.cn	客服电话	028-86150207

(28)申万宏源西部证券有限公司

住所、办公地址	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
法定代表人	王献军	联系人	王昊洋
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

(29)中泰证券股份有限公司

住所、办公地址	济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼		
注册地址	济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼		
法定代表人	王洪	联系人	张峰源
电话	021-20315719		
网址	http://www.zts.com.cn	客服电话	95538

(30)中国国际金融股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
法定代表人	陈亮	联系人	中金公司股票业务部

传真	010-65058065		
网址	http://www.cicc.com.cn	客服电话	4008209068

(31)财通证券股份有限公司

住所、办公地址	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼		
注册地址	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼		
法定代表人	章启诚	联系人	严泽文
网址	http://www.ctsec.com	客服电话	95336

(32)华鑫证券有限责任公司

住所	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A		
办公地址	上海市徐汇区云锦路 277 号西岸数字股二期 T3		
注册地址	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A		
法定代表人	俞洋	联系人	刘熠
电话	021-64339000		
网址	http://www.cfsc.com.cn	客服电话	95323，4001099918（全国）

(33)瑞银证券有限责任公司

住所	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12、15 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
法定代表人	陈安	联系人	牟冲
电话	（010）58328112	传真	(010)58328748
网址	http://www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

(34)中国中金财富证券有限公司

住所	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608
办公地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 20 层
注册地址	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608

法定代表人	王建力	联系人	陈梓基
网址	https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/	客服电话	95532

(35)东方财富证券股份有限公司

住所	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼		
办公地址	上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦		
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼		
法定代表人	戴彦	联系人	陈亚男
电话	021-23586583	传真	021-23586789
网址	http://www.18.cn	客服电话	95357

(36)国金证券股份有限公司

住所	成都市青羊区东城根上街 95 号		
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1088 号 7 楼		
注册地址	成都市青羊区东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	郭元媛
电话	15690849268		
网址	http://www.gjzq.com.cn	客服电话	95310

(37)华宝证券股份有限公司

住所、办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层		
法定代表人	刘加海	联系人	夏元
电话	（021）68777222	传真	（021）68777822
网址	http://www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

(38)财达证券股份有限公司

住所、办公地址	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦		
注册地址	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦		
法定代表人	张明	联系人	高晨婧
电话	0311-86273151		
网址	https://www.95363.com/	客服电话	河北省内:95363;河北省外:0311-95363

(39)湘财证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
法定代表人	高振营	联系人	江恩前
电话	(021)38784580		
网址	http://www.xcsc.com	客服电话	95351

(40)民生证券股份有限公司

住所、办公地址	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号		
法定代表人	顾伟	联系人	刘玥/曹宇鑫
电话	021-80508592/021-80508504		
网址	http://www.mszq.com	客服电话	021-80508866;021-80508332

(41)渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	安志勇	联系人	王星
电话	022-28451922		
网址	http://www.ewww.com.cn/	客服电话	956066

(42)东北证券股份有限公司

住所	吉林省长春市生态大街6666号		
办公地址	长春市生态大街6666号		
注册地址	吉林省长春市生态大街6666号		
法定代表人	李福春	联系人	安岩岩
电话	021-20361166		
网址	http://www.nesc.cn	客服电话	95360

(43)大同证券有限责任公司

住所	山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址	山西省太原市小店区长治路世贸中心12层

注册地址	山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层		
法定代表人	董祥	联系人	纪肖峰
电话	0351-7219280	传真	0351-4137986
网址	http://www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

(44)国联民生证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省无锡市金融一街8号		
注册地址	江苏省无锡市金融一街8号		
法定代表人	顾伟	联系人	庞芝慧
电话	15006172037		
网址	http://www.glms.com.cn	客服电话	95570

(45)第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
注册地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼		
法定代表人	吴礼顺	联系人	王雯
电话	0755-23838752		
网址	http://www.firstcapital.com.cn	客服电话	95358

(46)金元证券股份有限公司

住所、办公地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
注册地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
法定代表人	陆涛	联系人	唐乙丹
网址	http://www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(47)德邦证券股份有限公司

住所	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼		
办公地址	上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S2幢22楼		
注册地址	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼		
法定代表人	梁雷	联系人	张卉娟
电话	（021）68761616		
网址	http://www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

(48)华福证券有限责任公司

住所	福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层		
办公地址	福州市台江区江滨中大道 380 号宝地广场 18-19 层		
注册地址	福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层		
法定代表人	黄德良	联系人	林秋红
网址	http://www.hfzq.com.cn	客服电话	95547

(49)华源证券股份有限公司

住所	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号		
办公地址	武汉市江汉区青年路 278 号中海中心 32F-34F		
注册地址	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号		
法定代表人	邓晖	联系人	陈涛
电话	15618903281	传真	010-57672020
网址	http://www.huayuanstock.com	客服电话	95305

(50)首创证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层		
注册地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层		
法定代表人	张涛	联系人	梁健
网址	http://www.sczq.com.cn/	客服电话	95381

(51)华金证券股份有限公司

住所	上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室		
办公地址	上海市浦东新区杨高南路 759 号 27 层（陆家嘴世纪金融广场 2 号楼）		
注册地址	上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室		
法定代表人	燕文波	联系人	秦臻
电话	021-20655438	传真	021-20655438
网址	http://www.huajinsc.cn	客服电话	956011

(52)联储证券股份有限公司

住所	山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

注册地址	山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层		
法定代表人	张强	联系人	陈茜
电话	010-86499838	传真	010-86499401
网址	http://www.lczq.com/	客服电话	021-80295794;0755-36991988

(53)诚通证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路27号楼12层		
注册地址	北京市朝阳区东三环北路27号楼12层		
法定代表人	张威	联系人	廖晓
电话	010-83561321		
网址	www.cctgsc.com.cn	客服电话	95399

(54)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市新建区子实路1589号		
办公地址	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼		
注册地址	江西省南昌市新建区子实路1589号		
法定代表人	刘朝东	联系人	占文驰
电话	0791-88250812		
网址	https://www.gszq.com/	客服电话	956080

(55)甬兴证券有限公司

住所	浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层		
办公地址	上海市浦东新区南泉北路429号泰康保险大厦31、32层		
注册地址	浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层		
法定代表人	李抱	联系人	苏晓杰
电话	13917829777		
网址	https://www.yongxingsec.com	客服电话	400-916-0666

(56)江海证券有限公司

住所	哈尔滨市香坊区赣水路56号		
办公地址	哈尔滨市松北区创新三路833号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	赵洪波	联系人	周俊
网址	http://www.jhzq.c	客服电话	956007

	om.cn/		

(57)爱建证券有限责任公司

住所	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
办公地址	上海市浦东新区前滩大道 199 弄 5 号		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
法定代表人	江伟	联系人	赵婧玥
电话	021-32229888-25129		
网址	http://www.ajzq.com	客服电话	4001962502

(58)国新证券股份有限公司

住所	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室		
办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号		
注册地址	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室		
法定代表人	张海文	联系人	孙燕波
电话	010-85556048	传真	010-85556088
网址	https://crhcweb.crsec.com.cn/	客服电话	400-898-4999

(59)开源证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层		
注册地址	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层		
法定代表人	李刚	联系人	张蕊
传真	029-88365835		
网址	http://www.kysec.cn	客服电话	95325

2、二级市场交易代办证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的所有证券公司。

（二） 登记结算机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人	隋强
联系人	史昊

电话	（010）50938716
传真	（010）50938991

（三） 出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	陈颖华
电话	（021）31358666	传真	（021）31358600
经办律师	黎明、陈颖华		

（四） 会计师事务所和经办注册会计师

名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
办公地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
执行事务合伙人	唐恋炯	联系人	郭新华
电话	+86 (21) 6141 8888	传真	+86 (21) 6335 0003
经办注册会计师	汪芳、姜金玲		

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他法律法规的相关规定、并经中国证券监督管理委员会 2012 年 1 月 6 日《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]13 号）核准募集。

(一)基金运作方式和类型

1、基金的类别：股票型

2、基金的运作方式：交易型开放式

(二)基金存续期

不定期

(三)基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象

1、募集期：2012 年 2 月 20 日至 2012 年 3 月 16 日

2、募集方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

3、募集场所：投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

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

(四)募集目标

本基金不设定发售规模上限。

(五)基金的认购份额面值、认购价格

本基金每份基金份额初始面值为 1.00 元，按初始面值发售。

(六)认购费用

认购费用由投资者承担，认购费率不高于 1%,认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率

50万份以下	1.0%
50万份以上(含50万份)－100万份以下	0.5%
100万份以上(含100万份)	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下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、登记结算等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

(七)网上现金认购

1、认购时间：2012年2月20日至2012年3月16日

2、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额＝认购价格 ×认购份额 ×(1＋佣金比率)

认购佣金＝认购价格 ×认购份额 ×佣金比率

利息折算的份额＝利息/认购价格

网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

(八)网下现金认购

1、认购时间：2012年2月20日至2012年3月16日

2、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额＝认购价格 ×认购份额 ×（1＋认购费率）

认购费用＝认购价格 ×认购份额 ×认购费率

利息折算的份额＝利息/认购价格

网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。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。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

3、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＋1日进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

(九)网下股票认购

1、认购时间： 2012年3月12日至2012年3月16日

2、认购限额：

以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中创400指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：

(1)开立并使用深圳A股账户。

(2)在深圳A股账户中具备足够的符合要求的中创400指数成份股和已公告的备选成份股。

(3)投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

4、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。

5、特殊情形

(1)已公告的将被调出中创400指数的成份股不得用于认购本基金。

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

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

6、清算交收：T日日终(T日为本基金发售期最后一日)，发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资者申请认购的股票过户至本基金组合证券认购专户，完成验资后划入基金证券账户。基金管理人为投资者计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。《基金合同》生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

7、认购份额的计算公式：

投资者的认购份额＝Σ(第 i 只股票在 T 日的均价×有效认购数量)/1.00

其中，

(1)i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票，如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则 i＝1,i≤400。

(2)“第 i 只股票在 T 日的均价”由基金管理人根据深圳证券交易所的 T 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 T 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 T 日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在 T 日的均价进行调整：

①除息：调整后价格＝T 日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格＝T 日均价/(1＋每股送股比例)

③配股：调整后价格＝(T 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＝(T 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=（T 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=（T 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＝(T 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由登记结算机构完成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：

公式：

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

q_{max} ： 限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量；

$Cash$: 网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；

$p_j q_j$ ：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

股当日均价和认购申报数量乘积；

w ：该股按均价计算的其在网下股票认购日中创400指数中的权重，（认购期间如有中创400指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及中创400指数编制规则计算调整后的中创400指数构成权重，并以其作为计算依据）；

p ：该股在网下股票认购日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的，则按比例分配确认。

②若某一股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法冻结或执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

（十）募集期间认购资金与股票的处理方式

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用，认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归投资者所有；投资者以股票认购的，认购股票由发售代理机构予以冻结，并由登记结算机构于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户，该股票自认购日至划入前述专门账户前产生的孳息归认购投资者本人所有，不划入前述专门账户；在划入前述专门账户前，上述认购股票被强制执行、质押或非交易过户的，认购无效。

七、基金合同的生效

(一)基金合同的生效

本基金基金合同自 2012 年 3 月 22 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

(二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额的上市交易

(一)基金份额的上市

本基金于2012年5月11日在深圳证券交易所上市交易，基金场内简称：中创400ETF嘉实，基金代码：159918。

(二)基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、深交所《业务细则》及其他有关规定。

(三)暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的上市条件；

2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；

3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；

4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

当暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在指定媒介发布基金恢复上市公告。

(四)终止上市交易

基金份额上市交易后,有下列情形之一的,深圳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、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；

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、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

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

若因上述1、4项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式指数证券投资基金变更为以中创400指数为标的指数的非上市的开放式指数基金。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，确定是否选取其他合适的指数作为标的指数。

(五)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向深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单，深圳证券交易所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，计算并发布基金份额参考净值(IOPV)，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

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

2.基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

九、基金份额的申购、赎回

(一)申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金份额申购、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基金的申购和赎回。

(二)申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金自2012年5月11日起办理申购与赎回业务。

2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

基金管理人自《基金合同》生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回。本基金可在基金上市交易之前开始办理申购，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购；具体赎回业务办理时间在赎回开始公告中规定。

基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(三)申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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

本基金最小申购赎回单位为100万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定指定媒介公告并报中国证监会备案。

(四)申购和赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守深交所《业务细则》的相关规定。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

(五)申购和赎回的程序

1、申购和赎回申请的提出

基金投资者必须根据申购、赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按申购、赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

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股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理组合证券、基金份额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。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

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》的有关规定在指定媒介公告。

(六)申购、赎回的对价及费用

1、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，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。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

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

(七)申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

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

2、组合证券

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

3、现金替代相关内容

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

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

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

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2)可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券,替代金额的计算公式为：

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

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

③替代金额的处理程序

T日,基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日(简称为 T＋2 日)内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T＋2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T＋2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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

T＋2 日后第 1 个工作日(若在特例情况下,则为 T 日起第 21 个交易日),基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记结算机构,登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算：T＋2 日后 2 个工作日内(若在特例情况下,则为 T 日起第 22 个交易日)，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的交收。

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

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

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

(3)必须现金替代

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

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

4、预估现金差额相关内容

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

预估现金差额的计算公式为：

T 日预估现金差额＝T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整的前收盘价乘积之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整的前收盘价乘积之和)

其中，T 日经除权调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T＋1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额＝T 日最小申购赎回单位的资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价乘积之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价乘积之和)

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

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

6、申购赎回清单的格式

基本信息	
基金名称：	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	159918
目标指数代码：	399624
基金类型：	本市场 ETF

T-1 日 信息内容	
现金差额：	
最小申购、赎回单位资产净值：	

基金份额净值：	

T 日 信息内容	
预估现金差额：	
可以现金替代比例上限：	
是否需要公布 IOPV：	
最小申购、赎回单位：	
最小申购赎回单位现金红利：	
本市场申购赎回组合证券只数：	
全部申购赎回组合证券只数：	
是否开放申购：	
是否开放赎回：	
当天净申购的基金份额上限：	
当天净赎回的基金份额上限：	
单个证券账户当天净申购的基金份额上限：	
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限：	
当天累计可申购的基金份额上限：	
当天累计可赎回的基金份额上限：	
单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限：	
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限：	

组合信息内容								
证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	申购现金替代保证金率	赎回现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或者暂停接受投资者的申购、赎回申请：

1、因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购、赎回申请；

2、因特殊原因（包括但不限于深圳证券交易场所依法决定临时停市或在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；

3、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单；

5、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、深圳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；

6、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某些或某笔申购；

7、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申购赎回申请的措施。

8、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一（第6项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。

本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价时，基金管理人应暂停受理赎回申请，并在暂停当日至少通过深圳证券交易所和基金管理人网站公告。

在拒绝或暂停申购、赎回购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

（九）基金的份额折算

《基金合同》生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。

1、基金份额折算的时间

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

2、基金份额折算的原则

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

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

3、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

十、基金的非交易过户、冻结与解冻

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

十一、基金的投资

（一） 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

（二） 投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

（三） 投资理念

本基金以拟合、跟踪中创 400 指数为原则，通过被动式指数化投资方法，力求为投资者提供一个管理透明且成本较低的标的指数投资工具。

（四） 投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原

因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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

1、决策依据

有关法律、法规、《基金合同》和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，基金经理主要以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当指数投资的方法，以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行：集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金《招募说明书》及其更新中公告。

（五） 投资组合管理

1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，正常情况下本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将在《基金合同》生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1）由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2）个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3）成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4）相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5）其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为(如：股本变化、分红、停牌、复牌等)信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

3、定期投资组合管理

每月末，根据《基金合同》中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

每半年根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。

（六） 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：中创 400 指数。中创 400 指数挑选在深圳证券交易所的原中小企业板及创业板股票中，依据其前 6 个月的平均流通市值的比重和平均成交金额的比重按 2：1 的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名在位于 101-500 名的股票。

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向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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

（七） 风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

（八） 禁止行为

依照《基金法》,基金财产不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券；

2、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,但是国务院另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7、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；

8、依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

对于因上述 5、6 项情形导致无法投资的标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

（九） 投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

（2）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证，不得超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的， 遵从其规定；

（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

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

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

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

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

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

(8)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；

（9）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（10）法律法规以及监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除第(6)、(7)、(8)项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。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》生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。基金托管人对基金的投基金合同资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如法律法规或监管部门调整上述限制性规定，本基金管理人在履行适当程序后可按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

（十） 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（十一） 基金投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年01月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2025年12月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	77,539,867.29	98.97
	其中：股票	77,539,867.29	98.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	768,152.44	0.98
8	其他资产	38,577.36	0.05
9	合计	78,346,597.09	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	534,612.16	0.68
B	采矿业	694,627.60	0.89
C	制造业	56,506,875.33	72.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	281,306.32	0.36
E	建筑业	342,379.00	0.44
F	批发和零售业	1,738,359.85	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	349,047.84	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	10,178,602.88	13.00

	服务业		
J	金融业	2,500,499.32	3.19
K	房地产业	157,785.00	0.20
L	租赁和商务服务业	1,554,545.76	1.99
M	科学研究和技术服务业	762,632.00	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	272,040.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	270,284.00	0.35
Q	卫生和社会工作	377,129.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	985,731.28	1.26
S	综合	-	-
	合计	77,506,457.34	99.02

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,527.55	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,556.16	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,390.89	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,935.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,409.95	0.04

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002837	英维克	8,567	915,726.63	1.17
2	300136	信维通信	11,600	719,200.00	0.92
3	002738	中矿资源	9,100	714,805.00	0.91
4	300475	香农芯创	4,800	692,832.00	0.89
5	300604	长川科技	6,300	638,253.00	0.82
6	300115	长盈精密	13,566	630,819.00	0.81
7	300395	菲利华	6,100	611,830.00	0.78
8	002353	杰瑞股份	8,600	609,138.00	0.78
9	300058	蓝色光标	51,760	596,275.20	0.76
10	300255	常山药业	9,500	589,950.00	0.75

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301563	云汉芯城	64	8,556.16	0.01
2	301638	南网数字	309	4,390.89	0.01
3	301491	汉桑科技	63	3,471.93	0.00
4	301667	纳百川	60	3,424.20	0.00
5	301687	新广益	61	3,317.79	0.00

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

无。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明

细

无。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

无。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

(3) 本期国债期货投资评价

无。

11. 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	158.89

2	应收证券清算款	38,418.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,577.36

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301563	云汉芯城	8,556.16	0.01	新股锁定
2	301638	南网数字	4,390.89	0.01	新股锁定
3	301491	汉桑科技	3,471.93	0.00	新股锁定
4	301667	纳百川	3,424.20	0.00	新股锁定
5	301687	新广益	3,317.79	0.00	新股锁定

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十二、基金的业绩

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

（一） 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日	-9.66%	1.34%	-14.20%	1.47%	4.54%	-0.13%
2013 年	41.09%	1.60%	42.10%	1.61%	-1.01%	-0.01%
2014 年	22.44%	1.39%	23.37%	1.40%	-0.93%	-0.01%
2015 年	63.33%	2.76%	81.10%	2.83%	-17.77%	-0.07%
2016 年	-21.62%	2.06%	-21.60%	2.07%	-0.02%	-0.01%
2017 年	-11.87%	0.97%	-11.12%	0.97%	-0.75%	0.00%
2018 年	-35.33%	1.56%	-35.61%	1.56%	0.28%	0.00%
2019 年	32.54%	1.62%	32.48%	1.62%	0.06%	0.00%
2020 年	30.69%	1.86%	26.94%	1.87%	3.75%	-0.01%
2021 年	17.29%	1.17%	16.00%	1.18%	1.29%	-0.01%
2022 年	-23.64%	1.56%	-24.21%	1.58%	0.57%	-0.02%
2023 年	-3.80%	1.02%	-4.95%	1.05%	1.15%	-0.03%
2024 年	6.49%	2.19%	6.61%	2.23%	-0.12%	-0.04%
2025 年	32.83%	1.52%	31.91%	1.54%	0.92%	-0.02%

该时间区间历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2012 年 3 月 22 日至 2014 年 5 月 9 日；何如女士，管理时间为 2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 3 月 24 日至 2019 年 3 月 30 日；刘珈吟女士，管理时间为 2016 年 3 月 24 日至 2021 年 9 月 4 日；李直先生，管理时间为 2019 年 3 月 30 日至 2021 年 9 月 4 日；田光远先生，管理时间为 2021 年 9 月 4 日至 2024 年 2 月 1 日；张超梁先生，管理时间为 2024 年 2 月 1 日至 2026 年 11 月 7 日。

（二） 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

十三、基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

十四、基金的财产

(一)基金资产总值

本基金的基金资产总值包括各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

1、银行存款及其应计利息；

2、结算备付金及其应计利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；

4、应收证券交易清算款；

5、应收申购款；

6、股票投资及其估值调整；

7、债券投资及其估值调整和应计利息；

8、权证投资及其估值调整；

9、其他投资及其估值调整；

10、其他资产等。

(二)基金资产净值

本基金的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)基金资产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金非直销销售机构和基金登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)基金资产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金非直销销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金登记结算机构和基金非直销销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十五、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回对价的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

（四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值。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，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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，确定公允价格；

（4）上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值；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，确定公允价格；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、未上市交易的认沽/认购权证及因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

8、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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，以双方认可的方式发送给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

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基金估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值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。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错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，则该当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，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”），则差错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差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构的交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法规定的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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。

十六、基金的收益与分配

(一)收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权。

2、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人有权进行收益分配。

3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配6次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若《基金合同》生效不满3 个月可不进行收益分配；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。

5、本基金收益分配采取现金方式。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(二)基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金净值增长率与标的指数增长率的差额，当差额超过1%时，基金管理人有权进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

(三)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

(四)收益分配方案的确定与公告

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

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。

（五）收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

十七、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费；

(2)基金托管人的托管费；

(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

(5)基金上市费及年费；

(6)基金份额持有人大会费用；

(7)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

(8)基金的银行汇划费用；

(9)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费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值乘以0.5%的费率来计算,计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3)上述“1.基金费用的种类”中(3)至(9)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。

3、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

（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，不得从基金财产中列支；

（5）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(二)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。

十八、基金的会计与审计

(一)基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

(二)基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。基金管理人应在更换会计师事务所后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

十九、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（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及其日常机构等法律、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，依照《信息披露办法》的有关规定将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在相应网站上。

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

生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

2、基金份额发售公告

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

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日，下同）在指定报刊和网站上登载《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，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

5、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定报刊和网站上公告。

6、申购赎回清单

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

7、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

8、基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应至少提前两个工作日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

9、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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。

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

10、临时报告

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

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

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）基金合同》终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金募集期延长；

（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）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（19）变更标的指数；

（20）基金份额暂停、恢复、终止上市交易；

（21）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

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

11、澄清公告

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

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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

14、中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回清单、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

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

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

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

（七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。

二十、风险揭示

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

（2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

（4）购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

（5）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

（二）本基金特有的风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

2、标的指数波动的风险

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

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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

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

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

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

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

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

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

4、标的指数变更的风险

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

5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数的服务，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。

6、成份股停牌的风险

本基金的标的指数成份股可能出现停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后对相关成份股进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

8、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人在每一交易日开市前向深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单，深圳证券交易所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，计算并发布基金份额参考净值(IOPV)。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

9、退市风险

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

10、投资者申购失败的风险

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

11、投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

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

12、基金份额赎回对价的变现风险

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

13、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

（2）登记结算机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

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

14、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等

方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（三）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

（四）流动性风险

1、本基金的申购、赎回安排

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

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

2、拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，经考察中创 400 指数的成份股数量、日均成交量以及日均成交金额，该指数将具有充足的流动性可满足本基金投资的要求；本基金在组合构建过程中，将根据开放日申购和赎回情况，决定投资标的指数成份股及备选成份股的时间和方式，如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。因此，本基金拟投资市场及资产的流动性良好。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

3、 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

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申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

极端情况下，本基金投资组合内可能发生不具备足额符合要求的赎回对价，因此投资者可能面临基金资产不能迅速转变成现金或其他流动性资产。此时基金管理人应暂停受理赎回申请，并在暂停当日至少通过深圳证券交易所和基金管理人网站公告。

（五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

（六）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记结算机构、非直销销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（七）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及《基金合同》有关规定的风险。

（八）其它风险

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。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

（九）风险声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过非直销销售机构销售，但本基金并不是非直销销售机构的存款或负债，也没有经非直销销售机构担保或者背书，非直销销售机构并不能保证其收益或本金安全。

二十一、《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、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）转换基金运作方式；

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金份额持有人大会召开程序；

（9）终止《基金合同》；

（10）终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；

（11）法律法规规定的或《基金合同》明确约定应当由基金份额持有人大会审议决定的《基金合同》变更事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记结算机构的相关规则的修改或更新，或因中国证监会的相应规定，必须对《基金合同》进行修改；

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（6）基金管理人、深圳证券交易所和登记结算机构在法律法规、《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；

（7）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应按照届时有效的法律法规报中国证监会核准或备案，自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(二)《基金合同》的终止

出现下列情形之一的,《基金合同》终止：

1、经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。

《基金合同》终止后,基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

(三)基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止后，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）对基金财产进行分配。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二、《基金合同》内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利与义务

（1）基金份额持有人的权利

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）按照规定要求召开或自行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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9）法律法规、《基金合同》规定的其他权利。

（2）基金份额持有人的义务

1）遵守《基金合同》；

2）缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及法律法规和《基金合同》规定的费用；

3）在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；

4）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法利益的活动；

5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、非直销销售机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

6）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

7）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。

2、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

1）依法募集基金；

2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

4）销售基金份额；

5）召集基金份额持有人大会；

6）依据《基金合同》及有关法律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者的利益；

7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8）选择、委托、更换基金非直销销售机构，对基金非直销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登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用；

10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

16）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;如认为基金非直销销售机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

7）依法接受基金托管人的监督；

8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、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》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付申购或赎回之基金份额的对价；

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 15 年以上；

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

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

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

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

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

22）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；

23）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，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

25）建立并保管基金份额持有人名册，根据托管协议的约定定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

（1）基金托管人的权利

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

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

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

4）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定或经有权机关要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

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；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12）建立并保管基金份额持有人名册；

13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

15） 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

16）按照法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金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定；

22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金（即“嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

1、当出现或需要决定下列事由之一的，基金管理人，或基金托管人，或单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算）基金份额的基金份额持有人有权按照《基金合同》的约定提议召集或自行应当召集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）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（11）终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；

（12）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、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

（4）基于修改后的法律法规的要求、深圳证券交易所或者登记结算机构修改或更新的相关规则的要求，或基于中国证监会的相应规定，必须对《基金合同》进行修改；

（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（6）基金管理人、深圳证券交易所和登记结算机构在法律法规、《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；

（7）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、召集方式：

（1）除法律法规或《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。

（4）单独或合计代表基金份额10%以上（含10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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，单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

（5）单独或合计代表基金份额10%以上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，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%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

4、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，召集人应当于会议召开前40天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

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

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

5、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和监管机关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文件委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托文件符合法律法规、《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利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

3）本人直接出具书面表决意见或授权他人出具书面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 50%（含 50%）；

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

5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（3）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

6、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容为《基金合同》本部分第一条“召开事由”第1款所述事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额10%以上的基金份额持有人可以在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，临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。

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日30天前公告。

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：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

（2）议事程序

1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基

金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人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。签名册载明出席会议的基金份额持有人姓名或名称、身份证明文件名称及号码、持有或代表有表决权的基金份额、代理人的姓名及其身份证明文件名称及号码、其他事项等。

2）通讯开会

在通讯开会的情况下，应由召集人提前 40 日公布提案，在会议通知规定的表决截止日期后 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。

7、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交了符合会议通知规定的投资者身份证明文件的投资者即视为有效出席的投资者；符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出席会议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。

8、计票

（1）现场开会

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

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

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

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

（2）通讯方式开会

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

9、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日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（三）《基金合同》解除和终止的理由、程序

1、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、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《基金合同》规定的其他情形。

《基金合同》终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

2、基金财产的清算

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

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

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

（4）基金财产清算程序：

1）《基金合同》终止后，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）对基金财产进行分配。

（4）清算费用

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

（5）基金财产清算剩余资产的分配

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

（6）基金财产清算的公告

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

（7）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

（五）《基金合同》存放地和投资者取得《基金合同》的方式

本《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、非直销销售机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

二十三、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元

法定代表人：经雷

成立时间：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字【1999】5号

注册资本：1.5亿元人民币

组织形式：有限责任公司（外商投资、非独资）

经营范围：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

存续期间：持续经营

电话：　（010）65215588

传真：　（010）65185678

联系人：　罗朝伟

2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：廖林

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金

融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

b、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

c、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

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

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

f、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；

g、一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；因流通受限证券价格波动、基金规模变动等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券或在流通受限期结束后卖出流通受限证券。经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整。

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

i、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；

j、本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，基金管理人履行适当程序后，按照调整后的规定执行。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3）法规允许的基金投资比例调整期限

除第 f、h、i 项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

(3)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

1）承销证券；

2）向他人贷款或提供担保；

3）从事可能使基金承担无限责任的投资；

4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

对于因上述 5）、6）项情形导致无法投资的标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，按照调整后的规定执行。

(4)基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更，并自回函之日其按照变更后的名单对基金关联投资限制进行监督。

如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(5)基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1）基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人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，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或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，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担赔偿责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

2）基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担赔偿责任。

3）基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手名单中列明的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失由基金资产承担，但基金管理人应采取积极措施向交易对手追讨；在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人向基金托管人提供银行间市场交易的交易对手名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。基金管理人向基金托管人提供银行间市场交易的交易对手名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

(6)基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行。本基金投资于核心存款银行名单中列明的银行中的

银行存款，由于存款银行信用风险引起的损失，基金管理人不承担赔偿责任，但基金管理人应采取措施向责任方追讨；本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金管理人向基金托管人提供核心存款银行的名单，并及时更新调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

(7)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《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《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。

5）基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。

因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

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

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反关法律法规规定或者违反《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投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故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时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向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，并予协助配合。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。基金管理人有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金资产，未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金资产的资金账户和证券账户。

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

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，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责任。

2、募集资金的验证

基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名方式开立的证券账户下，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。同时，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事证券业务资格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方为有效。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款、股票解冻事宜。

3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人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公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

5、投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的交收数据办理本基金因申购、赎回产生的现金替代和现金差额的结算。

6、债券托管账户的开立和管理

（1）《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

7、其他账户的开设和管理

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

8、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

9、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应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

（五）基金资产净值计算和会计核算

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

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布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。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额持有人名册的登记与保管

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司担任本基金的登记结算机构，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由登记结算机构承担。基金份额持有人名册的内容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结算机构提供，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规规定承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、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

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各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》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的修改与终止

1、托管协议的变更

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

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

3、基金资产的清算

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

二十四、对基金份额持有人的服务

对本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。

以下是基金管理人提供的主要服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

（一）产品讯息咨询服务

投资者如果想查询基金净值、相关公告、基金产品与服务等信息，可通过拨打基金管理人客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，或登录本基金管理人网站（www.jsfund.cn）进行咨询、查询。

（二）客户投诉与建议受理服务

客户对我们工作的意见和建议，可通过客服热线、留言信箱、电子邮件或信函等方式向我们提出，对于普通投诉我们会在两天内予以回复，对于重大投诉的回复不超过 72 小时。

二十五、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过规定媒介（含基金管理人网站）公开披露。

序号	临时报告名称	披露时间
1	关于嘉实基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	2025 年 3 月 19 日
2	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	2025 年 4 月 8 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2025 年 5 月 22 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2025 年 7 月 5 日
5	关于中创 400 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	2025 年 8 月 6 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券股份有限公司为流动性服务商的公告	2025 年 12 月 29 日
7	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	2026 年 1 月 23 日
8	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	2026 年 1 月 23 日

二十六、《招募说明书》存放及查阅方式

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

二十七、备查文件

1、中国证监会核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的文件；

2、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 11 月 10 日