

# 上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（2021年3月更新）

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经中国证监会 2011 年 7 月 14 日证监许可[2011]1096 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 9 月 16 日生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

在投资本基金前，投资者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，对认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

本基金投资范围包括中国存托凭证，存在中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与中国存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌、摘牌等潜在风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要和《基金合同》等信息披露文件。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的标的指数为上证 380 指数。上证 380 指数由沪市 A 股中剔除上证 180 指数成份股后，规模适中、成长性好、盈利能力强的 380 只股票组成，综合反映沪市一批新兴蓝筹公司的股票价格表现。

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

本招募说明书的本次更新为依据中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》所作出的相应修订，并对基金管理人信息进行更新。其他信息内容截止日为 2020 年 9 月 16 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 6 月 30 日（未经审计）。

## 目录

§1 绪言.....	4
§2 释义.....	5
§3 基金管理人.....	9
§4 基金托管人.....	19
§5 相关服务机构.....	21
§6 基金的募集.....	29
§7 基金合同的生效.....	30
§8 基金份额折算.....	31
§9 基金份额的上市交易.....	32
§10 基金份额的申购和赎回.....	34
§11 基金的投资.....	42
§12 基金的财产.....	56
§13 基金资产估值.....	57
§14 基金的收益与分配.....	62
§15 基金的费用与税收.....	64
§16 基金的会计与审计.....	66
§17 基金的信息披露.....	67
§18 风险揭示.....	72
§19 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	77
§20 基金合同的内容摘要.....	80
§21 基金托管协议的内容摘要.....	98
§22 基金份额持有人服务.....	108
§23 其他应披露事项.....	110
§24 招募说明书存放及其查阅方式.....	111
§25 备查文件.....	112

## § 1 绪言

本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）以及《上证 380 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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## § 2 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指南方基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《公开募集开放式证券投资基金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
- 15、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订
- 16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

21、合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

25、ETF 联接基金：是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF（以下简称目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金

26、销售机构：指直销机构、发售代理机构及申购赎回代理券商

27、直销机构：指南方基金管理股份有限公司

28、基金销售网点：基金销售机构的销售网点

29、发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

30、发售协调人：指基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构

31、申购赎回代理券商：指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

32、登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司

33、登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务

34、指定交易：指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”

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

36、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

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

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所的正常交易日

42、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

43、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

44、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

45、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为，投资者可以现金或股票方式申请认购

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

47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件，向基金管理人卖出基金份额以取得申购赎回清单所规定的赎回对价的行为

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

49、申购对价：指投资者申购基金份额时，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

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

51、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

52、现金替代：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

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

54、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

55、基金份额参考净值：指上海证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

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

57、元：指人民币元

58、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

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

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

61、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

62、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

63、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

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

65、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## § 3 基金管理人

### 3.1 基金管理人概况

名称：南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：杨小松（代为履行法定代表人职责）

注册资本：3.6172 亿元人民币

电话：（0755）82763888

传真：（0755）82763889

联系人：常克川

1998 年，南方基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本增至 1.5 亿元人民币。2014 年公司进行增资扩股，注册资本金增至 3 亿元人民币。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。

2019 年 7 月 30 日，公司注册资本增至 3.6172 亿元，股权结构调整为华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。

### 3.2 主要人员情况

#### 3.2.1 董事会成员

张辉先生，管理学博士，中国籍。曾任职北京东城区人才交流服务中心、华晨集团上海办事处、通商控股有限公司、北京联创投资管理有限公司干部，华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、南通姚港路营业部副总经理、上海瑞金一路营业部总经理、证券投资部副总经理、综合事务部总经理、人力资源部总经理兼党委组织部长。现

任华泰证券股份有限公司执行委员会委员、董事会秘书，南方基金管理股份有限公司董事。

王连芬女士，金融专业硕士，中国籍。曾任职赛格集团销售，深圳投资基金管理公司投资一部研究室主任，大鹏证券经纪业务部副总经理、深圳福虹路营业部总经理、南方总部总经理、总裁助理，第一证券总裁助理，华泰联合证券深圳华强北路营业部总经理、渠道服务部总经理、运营中心总经理、零售客户部总经理、执行办主任、总裁助理，华泰证券总裁助理兼深圳分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司执行委员会主任助理兼深圳分公司总经理，南方基金管理股份有限公司董事。

冯青山先生，工学学士，中国籍。曾任职陆军第 124 师工兵营地爆连副连职排长、代政治指导员、师政治部组织科正连职干事，陆军第 42 集团军政治部组织处副营职干事，驻香港部队政治部组织处正营职干事，驻澳门部队政治部正营职干事，陆军第 163 师政治部宣传科副科长（正营职），深圳市纪委教育调研室主任科员、副处级纪检员、办公厅副主任、党风廉政建设室主任。现任深圳市投资控股有限公司董事、党委副书记、工会主席，深圳市投控资本有限公司监事，南方基金管理股份有限公司董事。

李平先生，工商管理硕士，中国籍。曾任职深圳市城市建设开发（集团）有限公司办公室文秘、主管和董办文秘、主管，深圳市投资控股有限公司办公室高级主管、企业三部高级主管、金融发展部副部长。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部部长，深圳市城市建设开发（集团）有限公司董事，深圳市投控资本有限公司董事，深圳资产管理有限公司董事，深圳市投控东海投资有限公司董事，南方基金管理股份有限公司董事。

李自成先生，近现代史专业硕士，中国籍。曾任职厦门大学哲学系团总支副书记，历任厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计财部经理、公司总经理助理，厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记、总经理，高级顾问。现任厦门国际信托有限公司高级顾问，南方基金管理股份有限公司董事。

王斌先生，临床医学博士，中国籍。曾任职安徽泗县人民医院临床医生，瑞金医院主治医师，兴业证券研究所医药行业研究员、总经理助理、副总监、副总经理（主持工作）、总经理。现任兴业证券经济与金融研究院院长，兴证智库主任，南方基金管理股份有限公司董事。

杨小松先生，经济学硕士，中国注册会计师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，美国 NASDAQ 实习职员，证监会处长、副主任，南方基金管理有限公司督察长。现任南方基金管理股份有限公司董事（代为履行董事长职务）、总裁、党委副书记，南方东英资产管理有限公司董事。

姚景源先生，经济学硕士，中国籍。曾任职国家经委副处长，商业部政策研究室副处长、国际合作司处长、副司长，中国国际贸易促进会商业行业分会副会长、常务副会长，国内贸易部商业发展中心主任，中国商业联合会副会长、秘书长，安徽省政府副秘书长，

安徽省阜阳市政府市长，安徽省统计局局长、党组书记，国家统计局总经济师兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员，国务院参事室社会调查中心理事长，国务院参事室与中国人民银行合作的金融研究中心专家委员会副主任，中国统计学会副会长，南方基金管理股份有限公司独立董事。

李心丹先生，金融学博士，国务院特殊津贴专家，中国籍。曾任职东南大学经济管理学院教授，南京大学工程管理学院院长。现任南京大学-牛津大学金融创新研究院院长、金融工程研究中心主任，南京大学教授、博士生导师，中国金融学年会常务理事，江苏省资本市场研究会会长，江苏省科技创新协会副会长、江苏银行监事、上海证券交易所科创板制度评估专家委员会主任，南方基金管理股份有限公司独立董事。

周锦涛先生，工商管理博士，法学硕士，香港证券及投资学会杰出资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)警务总督察，香港证券及期货专员办事处证券主任，香港证券及期货事务监察委员会法规执行部总监。现任香港金融管理局顾问，南方基金管理股份有限公司独立董事。

郑建彪先生，经济学硕士，工商管理硕士，中国注册会计师，中国籍。曾任职北京市财政局干部，深圳蛇口中华会计师事务所经理，京都会计师事务所副主任，中国证监会第九届股票发行审核委员会委员，中国证监会第一至三届上市公司并购重组专家咨询委员会委员。现任致同会计师事务所（特殊普通合伙）管理合伙人，中国并购公会副会长，北京注册会计师协会副会长，南方基金管理股份有限公司独立董事。

周蕊女士，法学硕士，中国籍。先后执业于万商天勤律师事务所、中伦律师事务所等国内知名律所，曾担任广东省律师协会女工委副主任、深圳市律师协会证券、基金与期货专业委员会副主任、深圳市律师协会国际与港澳台工作委员会副主任。现任金杜律师事务所合伙人、深交所第一届创业板上市委委员、中国并购公会广东分会会长、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深交所培训中心专家、南方基金管理股份有限公司独立董事。

### 3.2.2 监事会成员

吴晓东先生，法律博士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国证监会副处长、处长，华泰证券合规总监，华泰联合证券副总裁、党委书记、董事长，南方股权投资基金管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司监事会主席、南方股权投资基金管理有限公司监事。

陈莉女士，法学硕士，中国籍。曾任职华泰证券深圳民田路营业部总经理、深圳益田路营业部总经理、研究所副所长等职务。现任华泰证券股份有限公司研究所所长、华泰期货有限公司副董事长、华泰国际金融控股有限公司董事，南方基金管理股份有限公司监事。

姜丽花女士，大学学历，高级会计师，中国籍。曾任职浙江兰溪马涧碾米厂主管会计，浙江兰溪纺织机械厂主管会计，深圳市建筑机械动力公司主管会计，深圳市建设集团计划财务部助理会计师，深圳市建设投资控股公司计划财务部高级会计师、经理助理，深圳市投资控股有限公司计划财务部经理、财务预算部副部长、考核分配部部长、财务部（结算中心）部长（主任），兼任深圳经济特区房地产（集团）股份有限公司董事、深圳市建安（集团）股份有限公司董事、湖北深投控投资发展有限公司董事、ULTRARICH INTERNATIONAL LIMITED 董事。现任深圳市投资控股有限公司财务共享中心开发顾问，南方基金管理股份有限公司监事。

陈明雅女士，大学本科学历，注册会计师，中国籍。曾任厦门国际信托有限公司财务部副总经理。现任厦门国际信托有限公司财务部总经理、投资发展部总经理（兼任），南方基金管理股份有限公司监事。

林红珍女士，工商管理硕士，中国籍。曾任职厦门对外供应总公司会计，厦门中友贸易联合公司财务部副经理，厦门外供房地产开发公司财务部经理，兴业证券计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理（主持工作）、风险管理部总经理、财务部总经理、资金运营管理部总经理、计划财务部总经理。现任兴业证券首席财务官，南方基金管理股份有限公司监事。

徐刚先生，工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职深圳期货投资公司职员、项目经理，南方基金管理股份有限公司上海分公司职员、机构业务部职员、养老金业务部主管、上海分公司高级经理、副总经理、董事。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、养老金业务部董事。

董星华女士，硕士学历，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国人保武汉分公司、中国人寿再保险公司、中国再保险公司、深圳证券通信公司，南方基金管理股份有限公司综合管理部经理、办公室高级经理，现任南方基金管理股份有限公司职工监事、办公室董事。

苏望先生，法学硕士学位，中国籍，无境外永久居留权。曾任国信证券股份有限公司合规管理总部职员，深圳市融通资本管理股份有限公司职员。现任南方基金管理股份有限公司职工监事、监察稽核部高级副总裁。

### 3.2.3 公司高级管理人员

杨小松先生，总裁，简历同上。

俞文宏先生，副总裁，工商管理硕士，经济师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职江苏省投资公司业务经理，江苏国际招商公司部门经理，江苏省国际信托投资公司投资银

行部总经理，江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理，南方资本管理有限公司董事长。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

朱运东先生，副总裁，经济学学士，高级经济师，中国籍，无境外永久居留权。曾任职财政部地方预算司及办公厅秘书，中国经济开发信托投资公司综合管理部总经理，南方基金管理有限公司北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、党委委员。

常克川先生，副总裁，EMBA 工商管理硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职中国农业银行副处级秘书，南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理，华泰联合证券董事会秘书、合规总监等职务，南方资本管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍，无境外永久居留权。曾任职美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，南方基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总裁助理兼固定收益投资总监，南方东英资产管理有限公司董事。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（固定收益）。

史博先生，副总裁，经济学硕士，特许金融分析师（CFA），中国籍，无境外永久居留权。曾任职博时基金管理有限公司研究员、市场部总助，中国人寿资产管理有限公司股票部高级投资经理，泰达宏利基金管理有限公司投资副总监、研究总监、首席策略分析师、基金经理，南方基金管理有限公司基金经理、研究部总监、总裁助理兼首席投资官（权益）。现任南方基金管理股份有限公司副总裁、首席投资官（权益）、基金经理。

鲍文革先生，督察长，经济学硕士，中国籍，无境外永久居留权。曾任职财政部中华会计师事务所审计师，南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总裁助理。现任南方基金管理股份有限公司督察长，南方资本管理有限公司董事。

### 3.2.4 基金经理

本基金历任基金经理为：杨德龙先生，管理时间为 2011 年 9 月 16 日至 2016 年 3 月 4 日；柯晓先生，管理时间为 2013 年 5 月 17 日至 2016 年 11 月 25 日；周豪先生，管理时间为 2016 年 8 月 19 日至 2019 年 7 月 12 日；孙伟先生，管理时间为 2019 年 7 月 12 日至今。

孙伟先生，管理学学士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材

料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至今，任改革基金、高铁基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF、南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理。

### 3.2.5 投资决策委员会成员

副总裁兼首席投资官（固定收益）李海鹏先生，副总裁兼首席投资官（权益）史博先生，联席首席投资官孙鲁闽先生，现金投资部总经理夏晨曦先生，交易管理部总经理王珂女士，固定收益投资部总经理李璇女士，混合资产投资部总经理乔羽夫先生，固定收益研究部总经理陶铄先生，权益研究部总经理茅炜先生，权益投资部总经理张原先生，指数投资部总经理罗文杰女士，宏观策略部联席总经理唐小东先生。

### 3.2.6 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 3.3 基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 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、计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、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。

### 3.4 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

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

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

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- （9）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （10）贬损同行，以提高自己；
- （11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （12）以不正当手段谋求业务发展；
- （13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （14）其他法律、行政法规禁止的行为。

### 3.5 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (8) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### 3.6 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、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### 3.7 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，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指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。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

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，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、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、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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、岗位职责、操作守则等的具体说明。

## 2、内部控制原则

**健全性原则。**内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

**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。

**独立性原则。**公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

**相互制约原则。**公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

**成本效益原则。**公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，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、主要内部控制制度

### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定

期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflows。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## § 4 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：周海新

联系电话：(021)6063 7111

#### （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托

管银行”、在 2017 年及 2019 年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## § 5 相关服务机构

### 5.1 销售机构

#### 5.1.1 申购赎回代理证券公司

申购赎回代理证券公司：

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：南京市江东中路 228 号 法定代表人：周易 联系人：庞晓芸 联系电话：0755-82492193 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
2	兴业证券股份有限公司	注册地址：福州市湖东路 268 号 办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 联系电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：www.xyzq.com.cn
3	中国银河证券股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 法定代表人：陈共炎 联系人：辛国政 联系电话：010-83574507 客服电话：4008-888-888 或 95551 网址：www.chinastock.com.cn
4	海通证券股份有限公司	注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：周杰 电话：021-23219000 传真：021-23219100

		<p>联系人：李笑鸣                  客服电话：95553                  网址：www.htsec.com</p>
5	广发证券股份有限公司	<p>注册地址：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                  法定代表人：孙树明                  联系人：黄岚                  客服电话：95575、020-95575                  或致电各地营业网点                  网址：广发证券网  <a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
6	长城证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福田                  街道金田路 2026 号能源大厦                  南塔楼 10-19 层                  办公地址：深圳市福田区福田                  街道金田路 2026 号能源大厦                  南塔楼 10-19 层                  法定代表人：丁益                  联系人：纪毓灵                  联系电话：0755-83516289                  客服电话：0755-33680000                  4006666888                  网址：www.cgws.com</p>
7	招商证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福华                  一路 111 号                  办公地址：深圳市福田区福华                  一路 111 号招商证券大厦 23                  楼                  法定代表人：霍达                  联系人：黄婵君                  联系电话：0755-82960167                  客服电话：95565、4008888111                  网址：www.newone.com.cn</p>
8	申万宏源证券有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区长乐                  路 989 号 45 层                  办公地址：上海市徐汇区长乐                  路 989 号 40 层                  法定代表人：李梅                  联系人：陈宇                  电话：021-33389888                  传真：021-33388224</p>

		<p>客服电话：95523 或 4008895523</p> <p>网址： <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a></p>
9	光大证券股份有限公司	<p>注册地址:上海市静安区新闻路 1508 号</p> <p>办公地址:上海市静安区新闻路 1508 号</p> <p>法定代表人:刘秋明</p> <p>联系人:郁疆</p> <p>联系电话:021-22169999</p> <p>客服电话：95525</p> <p>网址： <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a></p>
10	中国中金财富证券有限公司	<p>注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元</p> <p>办公地址:深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层</p> <p>法定代表人:高涛</p> <p>联系人: 万玉琳</p> <p>联系电话：0755-82026907</p> <p>传真 0755-82026539</p> <p>客服电话：400-600-8008、95532</p> <p>网址： <a href="http://www.ciccwm.com">www.ciccwm.com</a></p>
11	申万宏源西部证券有限公司	<p>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</p> <p>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</p> <p>法定代表人: 李琦</p> <p>电话: 0991-5801913</p> <p>传真: 0991-5801466</p> <p>联系人: 王怀春</p> <p>客服电话: 400-800-0562</p> <p>网址: <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a></p>
12	湘财证券股份有限公司	<p>注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商</p>

		<p>务中心 A 栋 11 楼                  办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼                  法定代表人：高振营                  联系人：江恩前                  联系电话：                  021-38784580-8920                  客服电话：95351                  网址：www.xcsc.com</p>
13	信达证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼                  法定代表人：肖林                  联系人：付婷                  联系电话：010-63081000                  传真：010-63080978                  客服电话：95321                  网址：www.cindasc.com</p>
14	东方证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层                  办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层                  法定代表人：潘鑫军                  联系人：胡月茹                  联系电话：021-63325888                  客服电话：95503                  网址：www.dfzq.com.cn</p>
15	华西证券股份有限公司	<p>注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                  办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                  法定代表人：杨炯洋                  联系人：谢国梅                  客服电话：95584                  网址：www.hx168.com.cn</p>
16	东北证券股份有限公司	<p>注册地址：长春市生态大街 6666 号                  办公地址：长春市生态大街 6666 号</p>

		<p>法定代表人：李福春                  联系人：安岩岩                  联系电话：0431-85096517                  客服电话：95360                  网址：www.nesc.cn</p>
17	国联证券股份有限公司	<p>注册地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层                  办公地址：江苏省无锡滨湖区太湖新城金融一街 8 号 7-9 层                  法定代表人：姚志勇                  联系人：祁昊                  联系电话：0510-82831662                  客服电话：95570                  网址：www.glsc.com.cn</p>
18	渤海证券股份有限公司	<p>注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室                  办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号                  法定代表人：安志勇                  联系人：王星                  电话：022-28451922                  传真：022-28451892                  客服电话：400-651-5988                  网址：www.ewww.com.cn</p>
19	平安证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                  办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                  法定代表人：何之江                  联系人：王阳                  联系电话：021-38637436                  客服电话：95511-8                  网址：stock.pingan.com</p>
20	东吴证券股份有限公司	<p>注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号                  办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号                  法定代表人：范力                  联系人：陆晓                  电话：0512-62938521                  传真：0512-65588021</p>

		<p>客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn</p>
21	红塔证券股份有限公司	<p>注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼 办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼 法定代表人：李素明 联系人：杨敏珺 联系电话：0871-63353652 客服电话：956060 网址： <a href="http://www.hongtastock.com">http://www.hongtastock.com</a></p>
22	华宝证券有限责任公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层 法定代表人：陈林 联系人：刘闻川 电话：021-20657517 传真：021-68408217-7517 客服电话：4008209898 网址：www.cnhbstock.com</p>
23	华福证券有限责任公司	<p>注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼 法定代表人：黄金琳 联系人：王虹 电话：021-20655183 传真：021-20655196 客服电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：www.hfzq.com.cn</p>
24	西南证券股份有限公司	<p>注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号 法定代表人：廖庆轩 联系人：周青 联系电话：023-63786633 客服电话：4008096096</p>

		网址： <a href="http://www.swsc.com.cn">www.swsc.com.cn</a>
25	国元证券股份有限公司	注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号 办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券 法定代表人：蔡咏 联系人：米硕 联系电话：0551-68167601 客服电话：95578 网址： <a href="http://www.gyzq.com.cn">www.gyzq.com.cn</a>
26	大同证券有限责任公司	注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人：董祥 联系人：薛津 电话：0351-4130322 传真：0351-4192803 客服电话：4007121212 网址： <a href="http://www.dtsbc.com.cn">http://www.dtsbc.com.cn</a>
27	方正证券股份有限公司	注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层 法定代表人：施华 联系人：胡创 联系电话：010-59355997 客服电话：95571 网址： <a href="http://www.foundersc.com">www.foundersc.com</a>
28	粤开证券股份有限公司	注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层 办公地址：北京市朝阳区红军营南路天畅园 6 号楼 法定代表人：严亦斌 联系人：郭晴 联系电话：010-64408842 客户服务电话：95564 公司网址： <a href="http://www.ykzq.com">http://www.ykzq.com</a>

29	本基金其他代销机构情况详见基金管理人网站列示	

### 5.1.2 二级市场交易代理证券公司

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

### 5.2 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-59378982

传真：010-59378907

联系人：程爽

### 5.3 出具法律意见书的律师事务所

名称：广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路 1002 号宝安广场 A 座 16 楼 G.H 室

负责人：李兆良

电话：(0755)82687860

传真：(0755)82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

### 5.4 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：曹阳

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、曹阳

## § 6 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2011 年 7 月 14 日证监许可[2011]1096 号文批准募集。募集期从 2011 年 8 月 22 日至 2011 年 9 月 9 日止，共募集 330,448,915.00 份基金份额，募集户数为 4,059 户。

本基金的类型为股票型基金，运作方式为交易型开放式。基金存续期限为不定期。

## § 7 基金合同的生效

本基金合同于 2011 年 9 月 16 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## § 8 基金份额折算

### 一、基金份额折算的时间

本基金份额上市前不进行基金份额折算。在本基金份额上市后，为了更好的跟踪标的指数，基金管理人将根据运作情况决定是否对基金份额进行折算。基金管理人确定基金份额折算日，并提前公告。

### 二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人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。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。

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。

### 三、基金份额折算的方法

对基金份额折算后的基金份额持有人持有的基金份额计算至整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产），加总得到折算后的基金总份额。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。本基金管理人将根据折算比例调整最小申购赎回单位等安排。

## § 9 基金份额的上市交易

### 一、基金上市

本基金合同生效后，具备上市条件，于 2011 年 11 月 8 日开始在上海证券交易所上市交易。

### 二、基金份额的上市交易

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

若上海证券交易所增加 ETF 基金分级业务模式，本基金管理人将根据运作情况，与基金托管人协商一致后，决定是否增加本基金份额分级业务模式，届时需履行适当程序，并报中国证监会核准或备案后公告。

### 三、终止上市交易

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

- 1、不再具备本部分第一款规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

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

若因上述 1、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接以上证 380 指数为标的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的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

### 四、基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购赎回清单，上海证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算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部分) / 最小申购赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。若上海证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、上海证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

## § 10 基金份额的申购和赎回

### 10.1 申购与赎回场所

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

基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商。在相关条件许可的前提下，基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构。

### 10.2 申购与赎回的开放日及时间

#### 11、申购、赎回的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。若其后基金申请上市，上市期间基金可暂停办理申购。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金已于 2011 年 11 月 8 日开放申购赎回业务。

#### 2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），开放时间为上海证券交易所的交易时间。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

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。

### 10.3 申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人权益、不违背交易所相关规则的情况下可更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 10.4 申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足申购对价。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。

### 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。投资者应及时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上海证券交易所和登记结算机构的结算规则。

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基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在 T+1 日办理现金替代等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交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》及其后续修订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，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介公告。

## 10.5 申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位为 200 万份，基金管理人有权对其进行调整，并在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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，基金管理人有权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，具体请参见相关公告。

## 10.6 申购、赎回的对价、费用及其用途

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

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

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

## 10.7 申购、赎回清单的内容与格式

### 1、申购、赎回清单的内容

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

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

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

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

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

### （2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资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 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比率)

其中，“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。

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

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参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比率，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溢价比率，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，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

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

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

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

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

参考基金份额净值为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价。

该证券价格参考价格定义为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除，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 T 日预计开盘价。

### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分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，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金部分的计算公式为：

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

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

### 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额 = T 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须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 日收盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和)。

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

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

购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 6. 申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期 2011-7-1

基金名称 上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

基金管理公司名称 南方基金管理股份有限公司

一级市场基金代码 510291

T-1 日信息内容

现金差额(单位:元) -10728.00

最小申购赎回单位资产净值（单位：元） 2,000,000.00

基金份额净值（单位：元） 1.0000

T 日信息内容

预估现金部分（单位：元） -10728.00

现金替代比例上限 50%

是否需要公布 IOPV 是

最小申购赎回单位（单位：份） 2,000,000

申购、赎回的允许情况 是

## 10.8 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。

2. 证券交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3. 上海证券交易所、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，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。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。

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

5. 基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

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

7. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1 到 6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 10.9 暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。

2. 证券交易所依法决定临时停市或交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3. 上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。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。

4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

5. 基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

## 10.10 其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

### 10.11 集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

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

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

### 10.12 其他业务

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。

## § 11 基金的投资

### 11.1 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 11.2 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证（下同））、新股、债券、股指期货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。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金可投资存托凭证。

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

### 11.3 投资策略

#### （一）投资策略

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。

## （二）投资管理体制和程序

### （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制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；基金经理负责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

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程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。

**研究支持：**金融工程小组依托基金管理人整体研究平台，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。

**投资决策：**投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

**组合构建：**根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

**交易执行：**中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

**投资绩效评估：**金融工程小组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视投资策略，进而调整投资组合。

**组合维护：**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管理体制和程序做出调整，并在《招募说明书》中列示。

## 11.4 投资组合管理

## 1、构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、适当替代和逐步购入。

本基金采取完全复制法确定目标组合，其投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%。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。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。

## 2、日常投资组合管理

（1）可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。

（2）投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用自动化指数交易系统调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

（3）制作并公布申购、赎回清单：以 T 日标的指数权重为基础，考虑 T 日可能发生的上市公司变动情况，设计 T 日的申购赎回清单并公告。

## 3、定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：

- （1）定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案并实施；
- （2）根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案并实施；
- （3）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。

## 4、投资绩效评估

- （1）定期对基金的绩效评估进行，主要是对跟踪偏离度进行评估；
- （2）金融工程小组对本基金的运行情况进行量化评估；
- （3）基金经理根据量化评估报告，重点分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，本基金管理人需在方法变更前 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告，并阐明变更复制方法的原因。

## 11.5 投资限制

### （一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (8) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### （二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 100%；

(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(4) 本基金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%；

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

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(10) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（7）、（8）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 11.6 标的指数和业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证 380 指数，简称 380 指数。

上证 380 指数由上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日正式发布，反映了上海证券市场成长性蓝筹股表现，成份股数量 380 只。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点。

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。

## 11.7 风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 11.8 基金管理人代表基金行使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。

### 11.9 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。

### 11.10 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。

基金托管人根据本基金合同规定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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 6 月 30 日（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	176,423,940.14	99.23
	其中：股票	176,423,940.14	99.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,000.00	0.02

	其中：债券	37,000.00	0.02
	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	1,170,727.98	0.66
8	其他资产	166,077.75	0.09
9	合计	177,797,745.87	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	246,174.00	0.14
B	采矿业	6,838,490.46	3.85
C	制造业	92,032,903.97	51.84
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	8,935,015.44	5.03
E	建筑业	5,986,519.30	3.37
F	批发和零售业	17,049,376.45	9.60
G	交通运输、仓储和邮 政业	8,924,871.41	5.03
H	住宿和餐饮业	1,122,427.16	0.63
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	10,533,770.13	5.93
J	金融业	5,326,257.05	3.00
K	房地产业	8,831,527.85	4.97
L	租赁和商务服务业	1,597,393.91	0.90
M	科学研究和技术服务 业	1,407,600.60	0.79
N	水利、环境和公共设 施管理业	2,268,807.96	1.28
O	居民服务、修理和其 他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	1,396,200.00	0.79
R	文化、体育和娱乐业	2,400,638.00	1.35
S	综合	1,131,166.72	0.64
	合计	176,029,140.41	99.15

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	184,819.60	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	197,213.81	0.11
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	-	-
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	394,799.73	0.22

## 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3 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股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600739	辽宁成大	104,200	1,972,506.00	1.11
2	600529	山东药玻	32,400	1,879,200.00	1.06
3	600079	人福医药	64,500	1,755,690.00	0.99
4	600143	金发科技	122,700	1,615,959.00	0.91
5	600161	天坛生物	35,575	1,612,614.75	0.91
6	603444	吉比特	2,900	1,592,129.00	0.90
7	603658	安图生物	8,800	1,429,472.00	0.81
8	601128	常熟银行	186,619	1,401,508.69	0.79
9	603882	金域医学	15,600	1,396,200.00	0.79
10	600498	烽火通信	47,800	1,381,898.00	0.78

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688365	光云科技	3,032	131,043.04	0.07
2	688208	道通科技	1,491	80,856.93	0.05
3	603087	甘李药业	581	58,274.30	0.03
4	688555	泽达易盛	772	43,849.60	0.02
5	688568	中科星图	1,377	22,321.17	0.01

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	37,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,000.00	0.02

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113588	润达转债	230	23,000.00	0.01
2	113586	上机转债	140	14,000.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2009	IC2009	1	1,132,880.00	51,880.00	-
公允价值变动总额合计（元）					51,880.00
股指期货投资本期收益（元）					85,941.75
股指期货投资本期公允价值变动（元）					124,960.00

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的的指数的目的。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 11 投资组合报告附注

11.1 声明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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

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

11.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	140,575.39
2	应收证券清算款	25,188.57
3	应收股利	-
4	应收利息	313.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,077.75

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 11.5.2 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	688365	光云科技	131,043.04	0.07	科创板新股锁定期
2	688208	道通科技	80,856.93	0.05	科创板新股锁定期
3	688555	泽达易盛	43,849.60	0.02	科创板新股锁定期
4	688568	中科星图	22,321.17	0.01	新股未上市

#### 11.11 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
2011.9.16 -2011.12. 31	-18.74%	1.13%	-19.96%	1.58%	1.22%	-0.45%
2012.1.1- 2012.12.3 1	-1.02%	1.44%	-1.14%	1.44%	0.12%	0.00%
2013.1.1- 2013.12.3 1	14.31%	1.34%	13.84%	1.35%	0.47%	-0.01%
2014.1.1- 2014.12.3 1	44.86%	1.19%	45.17%	1.19%	-0.31%	0.00%
2015.1.1- 2015.12.3 1	38.26%	3.13%	37.93%	3.01%	0.33%	0.12%
2016.1.1- 2016.12.3 1	-16.41%	1.85%	-17.43%	1.86%	1.02%	-0.01%
2017.1.1- 2017.12.3 1	4.54%	0.87%	0.56%	0.88%	3.98%	-0.01%
2018.1.1- 2018.12.3 1	-29.18%	1.48%	-30.78%	1.50%	1.60%	-0.02%
2019.1.1- 2019.12.3 1	31.26%	1.32%	24.85%	1.33%	6.41%	-0.01%
2020.1.1- 2020.6.30	11.52%	1.59%	8.86%	1.59%	2.66%	0.00%
自基金成	66.79%	1.68%	40.91%	1.68%	25.88%	0.00%

立起至今						
------	--	--	--	--	--	--

## § 12 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，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。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## § 13 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的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营业日。

### 二、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。基金管理人与基金托管人协商一致后，可对估值方法进行调整；

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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。

6、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

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

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

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

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

### 四、估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

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

### 五、估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 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、或投资人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当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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不能预见、不能避免、不能克服，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人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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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，则其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财产损失时，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财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(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直接损失。

(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。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

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

4. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

## 七、基金净值的确认

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

#### 八、特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## § 14 基金的收益与分配

### 一、基金收益的构成

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

### 二、基金可供分配利润

期末可供分配利润指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 三、基金收益分配原则

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。

在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，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）。

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

3、本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

6、每一基金份额享有同等分配权；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，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上公告；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。
3. 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## § 15 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金上市费及年费；
7. 基金的指数许可使用费；
8. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
9. 基金的证券交易费用；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### 三、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3. 标的指数许可使用费

在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{标的指数许可使用费年费率} \div \text{当年天数}$$

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用费年费率为 0.03%。

H 为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，当本基金的季度日均基金资产净值（季度日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数）大于人民币 5000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限；基金设立首季，指数许可使用费不受收取下限的限制。指数许可使用费每季支付一次，每年 1 月，4 月，7 月，10 月的前十个工作日内支付上季度标的指数许可使用费。

4. 除管理费、托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 四、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

### 六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## § 16 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计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的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人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. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## § 17 基金的信息披露

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。

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体披露，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。

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份额发售机构；
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。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，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。

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

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。基金产品资料概要的正文应当包括产品概况、基金投资与净值表现、投资本基金涉及的费用、风险揭示与重要提示等中国证监会规定的披露事项，相关内容不得与基金合同、招募说明书有实质性差异。基金管理人将在《信息披露办法》实施之日起一年内，按照《信息披露办法》、《基金合同》及基金招募说明书规定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求执行。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

#### （三）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

#### （四）基金净值信息

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

#### （五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前 3 个工作日将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

#### （六）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，通过网站以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

### （七）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告需经具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

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

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

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

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

6. 基金持续运作过程中，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。

### （八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时，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：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、终止《基金合同》、基金清算；
- 3、基金扩募、延长基金合同期限；
- 4、转换基金运作方式、基金合并；
- 5、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；
- 6、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；
- 7、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、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；
- 9、基金募集期延长或提前结束募集；
- 10、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；
- 11、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；

12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

13、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；

14、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；

15、基金收益分配事项；

16、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；

17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、本基金变更标的指数；

21、基金份额停牌、终止上市交易；

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和基金合同约定的其他事项。

#### （九）澄清公告

在本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。

#### （十）清算报告

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

#### （十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息

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

#### （十三）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、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。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披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

#### (十四) 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。

## § 18 风险揭示

### 一、市场风险

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

1、政策风险。因国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

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

3、利率风险。利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。

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

5、购买力风险。因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### 二、管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2、基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

### 三、流动性风险

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

#### 1、本基金交易方式带来的流动性风险

（1）本基金最小申购、赎回单位设置较高（目前为 200 万份），中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

（2）基金在上海证券交易所上市交易，但不保证市场交易一定活跃；基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

（3）尽管由于投资者可以进行申购、赎回，基金一般不会持续出现大幅折溢价情况。但是，基金的二级市场交易价格受市场供求的影响，可能高于（称为溢价）或低于（称为折价）基金份额净值。

## 2、投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在证监会及相关法律法规规定的合法范围之内，且一般具备良好的市场流动性和可投资性。本基金投资范围的设定也合理、明确，操作性较强。本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，可少量投资于非成份股，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以上均为基金平稳运作提供了良好的基础。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本基金审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

## 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

本基金为交易型开放式基金，将依据市场最新流动性情况，在申购赎回清单中设定适当的每日赎回上限，以尽量规避巨额赎回导致的流动性风险。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人将时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按基金合同约定的时限支付赎回对价。

## 四、本基金特有风险

### 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及跟踪误差控制未达约定目标的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停

牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

#### 4、基金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。

#### 5、IOPV 计算错误的风险

证券交易所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。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担后果。

#### 6、投资者赎回失败的风险

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。

#### 7、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资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。

#### 8、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）登记机构可能调整结算制度，对投资者基金份额、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/期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### （4）指数编制机构停止服务的风险

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

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

#### 9、成份股停牌、摘牌的风险

标的指数的当前成份股可能会改变、停牌或摘牌，此后也可能会有其它股票加入成为该指数的成份股。本基金投资组合与相关指数成份股之间并非完全相关，在标的指数的成份股调整时，存在由于成份股停牌或流动性差等原因无法及时买卖成份股，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。当标的指数的成份股摘牌时，本基金可能无法及时卖出而导致基金净值下降，跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

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，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响，当基金管理人对该成份股予以调整时也可能产生跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

#### 10、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），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；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 五、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

#### 六、本基金投资股指期货的风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

- （1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

## 七、其他风险

如因技术因素、人为因素、战争、自然灾害等因素而产生的风险等。

## § 19 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

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

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 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；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。

### 二、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

#### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

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

#### 6. 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。

## § 20 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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. 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 交纳基金认购、申购、赎回对价及法律法规和基金合同所规定的费用；
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份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （二）基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 销售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规、上市交易所及登记结算机构相关业务规则的前提下，制订和调整本基金业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9. 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 选择、更换销售机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13. 依法召集基金份额持有人大会；
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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. 计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回清单；
9. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12. 编制季度报告、中期报告和年度报告；
13. 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；
14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
15. 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；
16. 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；
17. 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；
18. 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；
19. 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；
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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23. 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；
24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26. 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 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；
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律、法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 安全保管基金财产；
2. 设立专门的基金托管部，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. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 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；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回对价的现金部分；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 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；
16. 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；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 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；
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由本基金的基金份额持有人和本基金联接基金（即“南方上证 380 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”）的基金份额持有人组成，上述两类持有人可以委托其合法授权代表参会并表决。本基金的基金份额持有人持有的每一基金份额为一参会份额，每一参会份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

### （二）召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 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；
- (6) 基金管理人、销售机构、登记结算机构在法律法规或中国证监会许可的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户等业务的规则；
- (7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 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，应当自行召集。

3. 代表基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有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，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上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。

4. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 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。

#### (四) 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. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以召集人约定的非现场方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在表决截止日前公布 2 次提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

## (六) 议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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解释和说明。

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。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 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，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 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。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4. 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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 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。

### (八) 计票

#### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

#### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知

但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。

2. 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。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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。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。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### (一) 基金收益的构成

本基金合同项下基金收益是指基金利润。基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

3、本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

- 6、每一基金份额享有同等分配权；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### (五) 收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，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上公告；

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3. 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。

#### (六) 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

### 四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金上市费及年费；
7. 基金的指数许可使用费；
8. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
9. 基金的证券交易费用；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### (三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3. 标的指数许可使用费

在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{标的指数许可使用费率} \div \text{当年天数}$$

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用费率年费率为 0.03%。

H 为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，当季标的指数许可使用费不足 50,000 元的，按照 50,000 元支付；基金设立首季，指数许可使用费不受收取下限的限制。指数许可使用费每季支付一次，每年 1 月，4 月，7 月，10 月的前十个工作日内支付上季度标的指数许可使用费。

4. 除管理费、托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## (四) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （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最小化。

#### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证（下同）、新股、债券、股指期货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。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金可投资存托凭证。

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

#### （三）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- （8）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### （四）投资组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期

货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 100%；

(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(4) 本基金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%；

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

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(10) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（7）、（8）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

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

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### （一）基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

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

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 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；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。

### （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （8）参加与基金财产有关的民事诉讼；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）对基金剩余财产进行分配。

#### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

#### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；

- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

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

#### 6. 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。

### 八、争议解决方式

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

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

本基金合同受中国法律管辖。

### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## § 21 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

法定代表人：张海波

成立时间：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基字[1998]4 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 3.6172 亿元

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基

金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证（下同）、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金可投资存托凭证。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的 100%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（3）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%，经基金管理人和托管人协商，并履行相关程序后，可对以上比例进行调整。

（4）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%；

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

（6）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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内地上市交易的股票执行。

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

除上述第（7）、（8）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，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、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

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基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如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。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定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。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何

法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- （1）中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- （2）非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- （3）非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- （4）基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

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

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- （1）本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
- （2）在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- （3）有关比例限制的执行情况。
- （4）信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

（六）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。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金管理人对于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。

（八）基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和

本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（九）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

（十）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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、基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

（二）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、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、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人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。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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、基金财产保管

#### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6. 对于因为基金投资、认购和申购赎回过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人将认购款项划往基金认购专户；通过发售代理机构提交的网上、网下现金认购申请，于认购结束后由发售协调人将实际到位的认购资金划往基金募集专户；募集的股票由登记结算机构予以冻结。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。验资报告需对基金的募集资金和股数进行确认。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成，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，基金募集的股票存放在以基金托管人和本基金联名方式开立的证券账户下。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款、股票解冻等事宜。

## （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

## （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经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。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）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指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代的结算，并根据基金管理人的指令办理现金差额和现金替代多退少补款的结算。

#### （六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （七）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （八）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、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，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算与复核

### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定披露。

### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记结算机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更和终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

## § 22 基金份额持有人服务

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

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

若本基金包含在中国香港特别行政区销售的H类份额，则该H类份额持有人享有的服务项目一般情况下限于客户服务中心电话服务、客户投诉及建议受理服务和网站资讯等服务。

### 一、基金份额持有人交易资料的发送服务

#### 1、电子对账单

基金管理人提供场外交易电子邮件对账单、场外交易微信对账单服务，基金管理人将以电子邮件或微信服务通知形式向定制上述服务的个人投资者（本基金是否向个人投资者销售，请以本基金基金合同和招募说明书相关条款为准）定期发送对账单等相关信息，电子邮件地址不详的、微信未绑定或取消关注的除外。

#### 2、其他渠道对账单查询

注册登记机构和基金管理人不提供投资人的场内交易（本基金是否支持场内交易，请以本基金基金合同和招募说明书相关条款为准）对账单服务，投资人可到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务等渠道查询。

### 二、线上服务

通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）、微信公众号（可搜索“南方基金”或“NF4008898899”）或 APP 客户端，投资人可获得如下服务：

#### 1、账户查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，可享受场外基金交易查询、账户查询和相关基金信息查询等服务。

#### 2、网上交易服务

机构投资者可通过基金管理人网站，个人投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

#### 3、信息查询服务

投资人可以利用基金管理人网站等获取基金和基金管理人依法披露的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

#### 4、智能客服服务（7×24 小时）

投资人可通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，获得业务规则、净值信息等自助咨询服务。

#### 5、网上人工服务

投资人可通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

### 三、客户服务中心电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-889-8899 可享有如下服务：

1、自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。

2、人工服务：提供每周 7 天，每日不少于 8 小时的人工服务（法定节假日除外）。投资人可以通过该热线获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

### 四、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

## § 23 其他应披露事项

标题	公告日期
上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	2020-08-31
上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	2020-07-21
上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	2020-04-21
上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	2020-03-31

注：其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告

## § 24 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构和登记结算机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## § 25 备查文件

- 一、中国证监会核准上证 380 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 二、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 四、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金登记结算服务协议》
- 五、法律意见书
- 六、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 七、基金托管人业务资格批件、营业执照