

中银证券国证新能源车电池交易型开放式  
指数证券投资基金  
招募说明书

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二一年十一月

### 重要提示

中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证券监督管理委员会2021年5月12日证监许可【2021】1677号文准予注册。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、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。

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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、技术风险、流动性风险等，也包括本基金特有风险及其他风险等。

本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，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。

本基金的投资范围包括存托凭证，本基金投资存托凭证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。

本基金为指数基金，投资者可能面临基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险。

投资有风险，投资者认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

## 目 录

第一部分	绪言 .....	1
第二部分	释义 .....	2
第三部分	基金管理人 .....	8
第四部分	基金托管人 .....	20
第五部分	相关服务机构 .....	24
第六部分	基金的募集 .....	26
第七部分	基金合同的生效 .....	36
第八部分	基金份额的折算与变更登记.....	38
第九部分	基金份额的上市交易 .....	39
第十部分	基金份额的申购与赎回.....	41
第十一部分	基金的投资 .....	58
第十二部分	基金的财产 .....	67
第十三部分	基金资产估值 .....	68
第十四部分	基金的收益与分配 .....	75
第十五部分	基金费用与税收 .....	76
第十六部分	基金的会计与审计 .....	79
第十七部分	基金的信息披露 .....	80
第十八部分	风险揭示 .....	89
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	97
第二十部分	基金合同摘要 .....	100
第二十一部分	托管协议摘要 .....	120
第二十二部分	对基金份额持有人的服务.....	142
第二十三部分	其他应披露事项.....	145
第二十四部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	146
第二十五部分	备查文件 .....	147

## 第一部分 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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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》、《运作办法》、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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人：指中银国际证券股份有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、基金合同：指《中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中银证券国证新能源车电池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《中银证券国证新能源车电池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《中银证券国证新能源车电池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《中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

9、基金份额上市交易公告书：指《中银证券国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》

10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

16、交易型开放式指数证券投资基金：指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”，简称 ETF

17、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，通过投资于本基金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 ETF 联接

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

20、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

21、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

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

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

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

25、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

26、销售机构：指中银国际证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

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

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

29、登记业务：指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订以及相关业务规则所定义的基金份额的登记、存管和结算等相关业务

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

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）



38、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

39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、业务规则：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》及其不时修订的版本、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订的版本，以及基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布及其不时修订的其他相关规则和规定

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

42、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申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件，要求将基金份额兑换为基金合同和招募说明书约定的赎回对价的行为

44、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

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

46、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回申请人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

47、标的指数：指国证新能源车电池指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数

48、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

49、完全复制法：指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

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

51、现金替代：指申购或赎回过程中，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

52、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资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

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

54、元：指人民币元

55、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

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

57、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

58、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

59、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

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

61、基金份额参考净值：指基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算，并通过深圳证券交易所发布的基金份额参考净值，简称“IOPV”

62、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为

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

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

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

66、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

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

68、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

- 1、名称：中银国际证券股份有限公司
- 2、住所：中国上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层（邮政编码：200120）
- 3、设立日期：2002 年 2 月 28 日
- 4、法定代表人：宁敏
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字【2002】19 号
- 6、开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：中国证监会证监许可【2015】1972 号
- 7、组织形式：股份有限公司
- 8、存续期限：持续经营
- 9、联系电话：021-20328000
- 10、联系人：郜佳琪
- 11、基金网站：www.bocifunds.com

### 二、注册资本和股权结构

- 1、注册资本：27.78 亿元
- 2、股权结构

截止至本招募说明书公告日，公司股权结构如下：中银国际控股有限公司，持股比例 33.42%；中国石油集团资本有限责任公司，持股比例 14.32%；上海金融发展投资基金（有限合伙），持股比例 5.47%；江西铜业股份有限公司，持股比例 4.74%；云南省投资控股集团有限公司，持股比例 4.71%；中国通用技术(集团)控股有限责任公司，持股比例 4.09%；江苏洋河酒厂股份有限公司，持股比例 2.84%；上海祥众投资合伙企业（有限合伙），持股比例 2.73%；信泰人寿保险股份有限公司—传统产品，持股比例 2.36%；华润深国投信托有限公司—华润信托·春芽 68 号集合资金信托计划，持股比例 1.38%；其他股东合计持股比例 23.94%。

### 三、主要人员情况

#### 1、董事会成员

林景臻先生，硕士，经济师。曾任中国银行总行公司业务部客户关系管理总监、公司金融总部客户关系总监（公司业务），中国银行公司金融总部总经理（公司业务）、公司金融部总经理，中银香港（控股）有限公司及中国银行（香港）有限公司副总裁，中银国际控股有限公司董事长。现任中国银行执行董事、副行长，兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2018年5月31日起兼任中银国际证券股份有限公司董事长。

宁敏女士，博士、中国人民银行博士后。1999年7月至2009年9月，就职于中国银行总行，历任中国银行总行法律与合规部处员，总行授信执行部副处长，总行托管及投资者服务部高级合规官、主管。2009年9月至2013年8月，就职于中银基金，历任助理执行总裁、副执行总裁。2013年8月至2014年12月，在中国银行业监督管理委员会山东省监管局挂职，任副巡视员。2014年12月起至今，任公司执行总裁、董事。

祖宏昊先生，硕士。2004年8月至2013年7月，就职于中国银行股份有限公司辽宁省分行，历任人事教育处科员、人力资源部绩效与领导力团队主管、人力资源部招聘与配置团队主管。2013年7月至2016年4月，任辽宁省分行人力资源部副总经理。2016年4月至2019年6月，历任大连市分行人力资源部副总经理、副总经理（主持工作）、总经理。2019年6月至2020年8月，任大连市分行营业部总经理。2020年8月至2021年5月，任大连市沙河口支行行长。2021年5月至今，任中国银行股份有限公司人力资源部助理总经理。

文兰女士，工商管理硕士，中级会计师。1999年7月至2013年8月，就职于中国银行总行财务管理部，历任科员、高级经理、副主管、主管。2013年9月至2019年2月，就职于中国银行悉尼分行财务管理部，任部门总经理。2019年3月至2020年1月，就职于中国银行布里斯班分行，任行长。2020年2月至2021年4月，就职于中国银行总行财务管理部，任助理总经理。2021年4月起，就职于中国银行总行财务管理部，任副总经理。

王军先生，博士后。曾任中国银行总行公司业务部副处长、处长，总行电子银行部副总经理，山东省分行副行长、党委委员。现任中银国际控股有限公司副执行总裁。

赵雪松先生，硕士，高级会计师。曾在大连京大油田化学开发公司工作，曾任中国石油化学公司副总经理，中国石油天然气集团公司财务资产部资金处处长，中国石油天然气集团公司财务资产部副总会计师，中国石油天然气集团公司（股份公司）资金部副总会计师，现任中国石油集团资本有限责任公司副总经理，中国石油集团资本股份有限公司副总经理、党委委员。

郭旭扬先生，硕士，高级会计师。曾先后就职于南方石油勘探开发公司，任财务部成本会计；就职于苏丹大尼罗公司，任财务部资金主管；就职于南方石油勘探开发公司，任财务部成本预算主管；就职于中油国际（尼罗）有限责任公司，历任高级主管、财务资产部经理、总会计师；就职于中国石油国际勘探开发有限公司，历任财务与资本运营部会计管理中心会计核算分部经理、财务与资本运营部副主任；就职于中石油国际投资（澳大利亚）公司，任总会计师；就职于中石油尼罗河地区（尼罗河公司），任总会计师。现任中国石油集团资本有限责任公司财务总监，中国石油集团资本股份有限公司财务总监、董事会秘书。

吕厚军先生，经济学博士，高级经济师。曾先后任无锡建升期货经纪有限公司副总经理、江苏新思达投资管理顾问有限公司常务副总经理、建设银行苏州分行行长助理、建设银行江苏省分行国际业务部副总经理、海通证券有限公司投资银行总部总经理、海通证券有限公司国际业务部副总经理、海富产业投资基金管理公司总经理、董事，投资决策委员会主席，主持全面工作。现任金浦产业投资基金管理有限公司总裁。同时兼任上海国际股权投资基金协会理事长、上海股权投资协会副会长。

张静女士，大学本科，注册会计师。1994年9月至1998年7月，就职于昆明真达发展有限公司，任财务部经理。1998年7月至2000年8月，就职于云南联合审计师事务所，任助理审计员。2000年8月至2010年1月，就职于中审亚太会计师事务所，历任助理审计员、项目经理、高级项目经理。2010年1月起至今，就职于云南省投资控股集团有限公司，历任内审部副部长、风险管控部副部长，现任经营管理部副职领导。

艾富华先生，硕士，高级会计师。2003年7月至2009年7月，就职于江铜材料设备公司财务部，任科员。2009年7月至2015年5月，就职于江西铜业股份有限公司财务部预算分析板块，历任科员、负责人、经理。2015年5月至2018年3月，就职于江西铜业集团银山矿业有限责任公司，历任副总会计师、财务总监。2018年4月至2019年3月，就职于江西铜业股份有限公司财务管理部，任副总经理（主持工作）；2019年4月至今，担任江西铜业股份有限公司财务管理部总经理；2020年3月25日起，担任江西铜业集团有限公司金融事业部总裁。

李军先生，博士研究生（财政部财政科学研究所财政学专业）。曾任山东省兖州煤业集团会计；任财政部会计司主任科员；历任中国证监会期货监管部经纪公司监管处副处长、处长、交易所监管处处长；任大连商品交易所副总经理；任中国证监会会计部副主任；任北京华正均略管理咨询有限公司顾问。现任北京华钰基金管理有限公司董事长。

陆肖马先生，硕士。曾在四川锅炉厂、清华大学、State Street Bank & Trust 工作。曾任 State Street Bank & Trust 驻北京办事处首席代表，曾在中央汇金投资有限公司任职，担任中国建设银行董事，曾任深圳证券交易所副总经理、大连万达（上海）金融集团有限公司集团副总裁和投资公司首席执行官、康得投资集团有限公司常务副总裁。2017年12月起至今，任深圳前海东方弘远资产管理有限公司合伙人；2020年2月起至今，任 East Stone Acquisition Corporation 的 CEO。

丁伟先生，本科。曾任招商银行杭州分行办公室主任兼营业部总经理、行长助理、副行长；曾任招商银行南昌支行、南昌分行行长；曾于招商银行总行，历任人力资源部总经理、行长助理、副行长。2017年5月起至2020年9月，任招银网络科技（深圳）有限公司和招银云创（深圳）信息技术有限公司董事长。现任济宁银行股份有限公司和尚正基金管理有限公司独立董事。

王宇女士，博士，研究员、博导。曾先后就职于郑州大学经济法系，任讲师；就职于中国人民银行货币政策司，任副处长；就职于中国人民银行金融市场司，任处长；就职中国人民银行研究局，任副局长、巡视员；就职于中国人民银行，任参事。2020年12月退休。

王娴女士，博士，研究员。曾先后任职于中国建设银行昆明分行；任职于中国人民银行总行外资金融机构管理司；任职于中国证券监督管理委员会基金部、市场部，历任主任科员、副处长、处长、副主任。2016年8月至今，任清华大学五道口金融学院副院长。

## 2、监事会成员

徐朝莹先生，工商管理硕士。1996年8月参加工作，先后在中油财务有限责任公司、中国石油天然气集团公司上市筹备组、中国石油天然气股份有限公司财务部等处工作。曾任中国石油天然气股份有限公司资本运营部收购兼并处副处长、资本市场处处长、副总经济师。现任中国石油集团资本有限责任公司专职监事、中银国际证券股份有限公司监事会主席。

范寅先生，经济学硕士、高级经济师、CPA。曾任上海国际信托投资公司投资银行总部下属财务顾问部总经理，上海国际集团资产经营有限公司财务顾问部总经理，2006年3月调任上海国际集团发展研究总部，历任部门总经理助理、副总经理，金浦产业投资基金管理有限公司董事总经理。现任上海金浦健服股权投资管理有限公司总裁。

张丽娜女士，硕士，公司律师。曾先后就职于北京德恒（昆明）律师事务所，任实习律师；就职于云南能源金融控股有限公司（现更名为：云南能投资本投资有限公司），任公司法务。2018年12月至今，就职于云南省投资控股集团集团有限公司，任公司法律风险管理岗。

金坚先生，硕士。曾在中央电视台无锡太湖影视城、中视传媒股份有限公司、招商证券股份有限公司上海地区总部、上海市虹口区审计局工作。2003年进入中银证券以来，曾任公司零售经纪部副总经理，深圳证券营业部总经理，零售经纪部执行总经理，业务管理部联席总经理。现任中银国际证券股份有限公司战略规划部联席总经理。

马骏先生，本科。曾在中国银行上海市分行、联合汽车电子有限公司、阿尔斯通技术服务有限公司工作。2007年以来一直在中银国际证券股份有限公司人力资源部工作，现任人力资源部副总经理。

## 3、公司高级管理人员

宁敏女士：博士、中国人民银行博士后。1999年7月至2009年9月，就职于中国银行总行，历任中国银行总行法律与合规部处员，总行授信执行部副



处长，总行托管及投资者服务部高级合规官、主管。2009年9月至2013年8月，就职于中银基金，历任助理执行总裁、副执行总裁。2013年8月至2014年12月，在中国银行业监督管理委员会山东省监管局挂职，任副巡视员。2014年12月至2020年10月，任公司执行总裁、董事。现任公司党委书记、执行总裁、董事。

沈锋先生：硕士，中级经济师。1992年8月至1997年4月，就职于中国银行江苏省南通分行海门支行，历任科员、科长。1997年4月至1999年8月，就职于中国银行江苏省南通分行通州支行，任行长助理。1999年8月至2000年10月，就职于中国银行江苏省南通分行启东支行，任副行长。2000年10月至2002年2月，就职于中国银行江苏省南通分行海安支行，任行长。2002年2月至2005年5月，就职于中国银行江苏省淮安市分行，任副行长。2005年5月至2008年1月，就职于中国银行江苏省分行个人金融部，任副总经理。2008年1月至2009年12月，就职于中国银行江苏省宿迁分行，任行长。2009年12月至2011年8月，就职于中国银行江苏省分行个人金融部，任总经理。2011年8月至2016年3月，就职于中国银行河北省分行，任行长助理、副行长。2016年4月至2020年10月，任公司副执行总裁。现任公司党委委员、副执行总裁。

翟增军先生：硕士，高级会计师。1992年8月至2001年3月，就职于中石油华东设计院，任副处长。2001年4月至2007年10月，就职于中石油资本运营部，任副处长。2007年11月起至今，历任公司稽核部主管、稽核总监、监事长，现任公司董事会秘书。

赵向雷先生：硕士，高级经济师。1986年6月至1988年9月，就职于中国人民银行总行金融管理司，任副主任科员。1988年9月至1996年3月，就职于中国银行西安市分行，历任副主任科员、科长、副处长。1996年3月至1998年9月，就职于中国银行港澳管理处，任经理。1998年9月至2001年3月，就职于中银国际控股，任执行董事。2001年4月至2002年2月，就职于中银国际控股北京代表处，任执行董事。2002年2月起至今，历任公司资金部、风险管理部、人力资源部主管、公司风险总监兼合规总监，现任公司风险总监。

盖文国先生：硕士，高级会计师。1988年7月至2000年11月，就职于锦州石化股份有限公司，历任预算员、办公室副主任、董事会秘书。2000年12月至2015年5月，就职于中石油，历任副处长、处室负责人、专职监事。2015年6月起至今，曾任公司稽核部总经理，现任公司稽核总监。

沈奕先生：硕士，会计师。1996年7月至1997年12月，就职于珠海市计委。1997年12月至2004年9月，就职于光大证券有限责任公司，历任投资银行部助理总经理、副总经理、董事总经理。2004年9月至2009年12月，就职于恒泰证券有限责任公司，任公司副总裁。2009年12月至2012年12月，就职于光大证券股份有限公司，任公司投资银行总监。2012年12月至2018年6月，就职于瑞银证券有限责任公司，任公司董事总经理、内核负责人、上海分公司总经理。2018年6月起至今，担任公司投资银行板块管理委员会主席。

许峥先生：学士。1995年7月至1996年10月，就职于上海中达斯米克电器电子有限公司，任工程师。1996年10月至1997年4月，就职于上海金鑫计算机系统工程有限公司，任软件开发工程师。1997年4月至2016年8月，就职于光大证券股份有限公司，历任上海总部电脑工程部副总、网上经纪公司（筹）技术部总经理、信息技术部技术管理部总经理。2016年8月至2019年9月，就职于西藏东方财富证券股份有限公司，历任技术开发部总经理、首席信息官。2019年9月起至今，担任公司信息管理委员会主席。

亓磊先生：硕士。2006年7月至2008年6月，就职于福州电业局。2008年6月至2015年9月，就职于上海证监局，历任副主任科员、主任科员。2015年10月至2017年9月，就职于富国资产管理（上海）有限公司，任风险管理部负责人。2017年10月起至今，历任公司内控与法律合规部副总经理（主持工作）、风险合规管理板块总经理，现任公司合规总监兼公司公募基金业务合规负责人。

刘国强先生：硕士。1999年3月至2000年5月，就职于大鹏证券有限责任公司，任投资银行部项目经理。2000年5月至2002年3月，就职于招商证券有限责任公司，任投资银行部高级项目经理。2002年3月至2007年4月，就职于中银证券，任投资银行部副总经理。2007年4月至2012年12月，就职于中国国际金融股份有限公司，任投资银行部执行总经理。2012年12月起，

历任公司企业融资部团队主管，股权融资一部总经理、总裁助理，现任公司财务总监。

徐高先生：博士。2008年5月至2010年6月，就职于世界银行中国和蒙古局，任经济学家。2010年7月至2011年4月，就职于瑞银证券，任高级经济学家。2011年5月至2016年11月，就职于光大证券股份有限公司，任首席经济学家。2016年12月至2019年4月，就职于光大证券资产管理有限公司，任首席经济学家。2019年5月起，历任公司首席经济学家、总裁助理兼首席经济学家，现任公司研究总监兼首席经济学家。

赵青伟先生：硕士。2000年7月至2015年11月就职于中国银行，历任总行金融市场总部交易员、投资经理、高级投资经理、团队主管、中国银行上海分行浦东开发区支行副行长、中国银行总行投资银行与资产管理部主管。2015年11月至2016年12月，就职于中融汇今资产管理有限公司，任副总裁。2016年12月至2018年12月，就职于友山基金管理有限公司工作，任副总裁。2019年1月起，历任公司资产管理板块总经理、总裁助理兼资产管理板块总经理，现任公司资管总监。

#### 4、基金经理

计伟，硕士研究生。2012年1月至2016年8月任职于华安基金管理有限公司，担任基金经理；2016年8月至2019年7月任职于汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资副总经理、ETF投资部总经理、基金经理；2019年10月加入中银国际证券股份有限公司，现任基金管理部ETF投资团队负责人及中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

张艺敏，硕士研究生。2017年7月至2020年5月任职于汇安基金管理有限公司，历任产品及创新业务部产品经理、ETF投资部基金经理助理，2020年5月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金、中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

基金管理人采取集体投资决策制度，公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

主任：赵青伟先生（总裁助理）

副主任：张少华先生（资产管理板块副总经理兼基金管理部总经理）

委员：

王玉玺女士（基金管理部副总经理）

饶晓先生（研究与交易部负责人）

王永民先生（信评与投资监督部负责人）

余亮先生（基金管理部助理总经理）

蒲延杰先生（基金管理部权益投资团队负责人）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 四、基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集资金，办理或者委托经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、转换和登记事宜；
- 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、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

## 五、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生；

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，不按照规定履行职责；

(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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

### 5、基金经理承诺

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

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

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

## 六、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制原则

健全性原则。基金业务内部控制必须覆盖公司涉及基金业务的各个机构和各级岗位及人员，涵盖公司基金业务决策、执行、监督、反馈等各个经营过程和环节。

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，维护公司基金业务内控制度的有效执行。

独立性原则。公司涉及基金业务的各相关机构和岗位职责应保持相对独立。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应相互分离。

相互制约原则。公司涉及基金业务的内部机构和岗位设置应权责分明、相互制衡。

成本效益原则。公司运用科学的经营管理方法降低基金业务运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的基金业务内部控制效果。

### 2、内部控制的组织体系

公司董事会或经董事会授权的机构或个人，负责制定公司基金业务内部控制规划，制定并持续完善基金业务内部控制大纲；建立健全基金业务内部控制的基本组织架构，明确职责分工；审议批准基金业务基本管理制度；检查相关管理制度的实施；对公司基金业务风险及内部控制的有效性进行检查评估；审议批准基金投资运作中的重大关联交易；审议批准基金审计事务，聘请或更换基金会计师事务所；审议批准基金季度报告、中期报告和年度报告及其他依据相关规范需由董事会负责的基金经营管理事项。

公司独立董事应独立于公司及其股东，以基金份额持有人利益最大化为出发点，勤勉尽责，依法对公司基金财产和基金运作的重大事项独立作出客观、公正的专业判断；应关注并督促公司避免在基金业务中出现不正当关联交易、利益输送和内部人控制等现象，维护基金持有人及公司的合法权益。

公司监事会对董事会、执行委员会和合规总监履行基金业务内部控制职责情况负有监督责任。应对公司基金业务内部控制的有效开展提出建议和意见，应关注并督促公司避免在基金业务中出现不正当关联交易、利益输送和内部人控制等现象，维护基金持有人及公司的合法权益。

公司执行委员会对公司基金业务内部控制制度的有效执行承担责任。就公司执行董事会有关基金业务内部控制决策的情况向董事会负责并报告，接受董事会的监督。

公司指定合规总监参照《证券投资基金管理公司管理办法》及《证券投资基金管理公司督察长管理规定》中有关证券投资基金管理公司督察长职责的规定组织落实对公司基金业务经营运作的合法合规性及风险控制情况进行监督检查和监察稽核的职责。合规总监履行职责，应以保护基金份额持有人利益为根本出发点，公平对待全体基金投资者。在公司、股东利益与基金份额持有人利益发生冲突时，优先保障基金份额持有人的利益。合规总监开展工作，应当坚持原则、忠于职守、专业诚信、勤勉尽责。公司董事会、执行委员会应提供必要条件，确保合规总监独立、有效地履行职责。

### 3、内部控制制度概述

公司基金业务内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章组成。内部控制大纲是公司基金业务各项基本管理制度的纲要和总揽，明确了公司基金业务内部控制的目标、原则、控制环境、控制措施和控制内容等事项。公司及基金业务涉及的公司各相关机构应依据本大纲的要求，结合公司实际情况，制定科学完善的基金业务各项基本管理制度、部门业务规章等内部控制制度，建立科学合理、控制严密、运行高效的基金业务内部控制体系，保证公司对基金业务内部控制的有效性。公司基金业务基本管理制度包括基金业务风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度。公司基金业务部门业务规章是在基金业务基本管理制度的基础上，对基金业务相关机构的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 12 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 162 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2020 年 6 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 10.67 万亿元。2020 年 1-6 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 365.05 亿元。

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

#### （二）主要人员情况



任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2020 年 6 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 478 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

## （二）内部控制原则

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

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

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

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

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

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

## （三）内部控制制度及措施

根据《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业

务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

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

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

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

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构

#### 1、网下现金和网下股票发售直销机构：

中银国际证券股份有限公司直销柜台

住所：中国上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层（邮政编码：200120）

办公地址：北京市西城区西单北大街 110 号 7 层（邮政编码：100032）

法定代表人：宁敏

电话：010-66229088

传真：010-66578971

联系人：屈研、陈哲、陈淑萍

#### 2、网下现金和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

#### 3、网上现金发售代理机构

投资者可直接通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，具体详见基金管理人网站。

### 二、申购赎回代理券商、二级市场交易代办证券公司

详见基金管理人网站。

### 三、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

#### 四、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、范佳斐

#### 五、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）

注册地址：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：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张振波、叶尔甸

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：叶尔甸

## 第六部分 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》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，经 2021 年 5 月 12 日中国证监会证监许可【2021】1677 号文件注册募集。

### 一、基金类型、运作方式和存续期间

基金类型：股票型指数证券投资基金

基金运作方式：交易型开放式

存续期限：不定期

### 二、标的指数

本基金的标的指数为国证新能源车电池指数。

### 三、发售方式和销售渠道

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 种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

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

基金管理人可根据实际情况调整本基金的发售方式或发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

#### 四、募集期限

本基金的募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

具体募集方案以基金份额发售公告为准，请投资者就发售和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

#### 五、募集对象

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

#### 六、基金份额初始面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.0000 元，按初始面值发售。

#### 七、基金的最低募集份额总额和金额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元。

#### 八、基金份额类别设置

在法律法规允许并且对届时基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后，本基金可增设新的份额类别。新的份额类别可设置不同的申购费、赎回费，基金管理人可就增设后的全部或部分份额申请上市，并制定、公布相应的申购、赎回等交易的规

则，无需召开持有人大会审议。有关基金份额类别的具体规则等相关事项届时将另行公告。

## 九、认购开户

1、投资人认购本基金时需具有深圳证券账户，深圳证券账户是指深圳证券交易所 A 股账户或基金账户。

2、投资人应注意：

(1) 基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立上海证券交易所 A 股账户。

(2) 如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳证券交易所 A 股账户与上海证券交易所 A 股账户。

(3) 如投资人同时使用深圳证券交易所 A 股账户与上海证券交易所 A 股账户，该两个账户的证件号码及名称应属于同一投资人所有，并注意投资人用以认购、申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海证券交易所 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商，否则无法办理本基金的申购和赎回。

3、已购买过由中银国际证券股份有限公司担任登记结算机构的基金的投资人，其拥有的中银国际证券股份有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

## 十、认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由投资人承担。投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。



认购份额 (M)	认购费率
M < 50 万份	0.80%
50 万份 ≤ M < 100 万份	0.50%
M ≥ 100 万份	1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和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。

## 十一、网上现金认购

### 1、认购时间：

详见基金份额发售公告。

### 2、认购限额：

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

### 3、认购申请：

投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后不得撤销。

### 4、清算交收：

投资者提交的认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

### 5、认购确认：

在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

### 6、认购金额的计算：

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 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产生的利息将折算为基金份额归投资人所有，利息折算的份额以登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购 10,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，并假设认购资金募集期间产生的利息为 2.00 元，则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

认购佣金=1.00×10,000×0.8%=80.00 元

认购金额=1.00×10,000×(1+0.8%)=10,080.00 元

利息折算的份额=2.00/1.00=2 份

即，投资人需准备 10,080.00 元资金，方可认购到 10,000 份本基金基金份额，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 10,002 份基金份额。

## 十二、网下现金认购

### 1、认购时间：

详见基金份额发售公告

### 2、认购限额：

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。

### 3、认购手续：

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

#### 4、清算交收：

通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

#### 5、认购确认：

在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

#### 6、认购金额的计算：

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

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

总认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购本基金 1,000,000 份，认购费率为 1,000 元，假定认购金额产生的利息为 10 元，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

认购费用=1,000 元

认购金额=1.00×1,000,000+1,000=1,001,000 元

该投资人所得认购份额为：总认购份额=1,000,000+10/1.00=1,000,010 份

即，若该投资人通过基金管理人网下现金认购本基金 1,000,000 份，则该投资人的认购金额为 1,001,000 元，假定该笔认购金额产生利息 10 元，则可得到 1,000,010 份基金份额。

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

### 十三、网下股票认购

#### 1、认购时间：

详见基金份额发售公告。

#### 2、认购限额：

网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是国证新能源车电池指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资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：

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销，发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

#### 4、特殊情形

（1）已公告的将被调出国证新能源车电池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。

(4) 根据法律法规本基金不得持有的国证新能源车电池指数的成份股，将不能用于认购本基金。

#### 5、清算交收：

网下股票认购期 T 日日终（T 日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金发售期结束后，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购费用，并从投资人的认购份额中扣除，然后将扣除的认购费用以基金份额的形式返还给发售代理机构。登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记，并根据基金管理人报深圳证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资人申请认购的股票过户到基金的证券账户。

若深圳证券交易所、登记机构对网下股票认购业务的清算交收流程有所修订或调整的，本基金将进行相应调整。

#### 6、认购份额的计算方式：

投资者的认购份额 =  $\sum_{i=1}^n$  （第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 × 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，n 代表投资者提交的股票总只数，如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则 n=1。

(2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，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网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

①除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

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

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

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

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

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

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。

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的计算方式详见届时相关公告。

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

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法冻结或执行，基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资

者的有效认购数量进行相应调整。

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

#### **十四、募集资金利息或股票权益的处理方式**

网上现金认购及网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以基金管理人和/或登记机构的记录为准；投资人以股票认购的，认购股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户，最终将投资人申请认购的股票过户至基金证券账户。

#### **十五、募集期间的资金、股票与费用**

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；募集的股票由登记结算机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

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

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金和股票的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、针对投资人以现金交纳的认购资金，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项并加计银行同期活期存款利息；网下股票认购所募集股票的解冻按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》的规定处理；



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

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的折算与变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利或根据需要，本基金可以进行份额折算。

### 一、基金份额折算的时间

基金合同生效后，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。

### 二、基金份额折算的原则

由基金管理人向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算由基金管理人办理并由登记结算机构进行基金份额变更登记。

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或遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算，并及时公告。

### 三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在基金份额折算公告中列示。

## 第九部分 基金份额的上市交易

### 一、基金份额的上市

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

- 1、基金场内资产净值不低于 2 亿元人民币；
- 2、基金场内份额持有人不少于 1,000 人；
- 3、符合深圳证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。本基金基金份额获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在本基金基金份额上市日前按照相关法律法规要求发布基金份额上市交易公告书及上市交易公告书提示性公告。

### 二、基金份额的上市交易

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》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

### 三、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向深圳证券交易所发送，由深圳证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

- 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以现金替代的证券数量与其最新成交价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止现金替代的证券数量与其最新成交价乘积之和 + 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、深圳证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值的计算方法，并予以公告。

#### 四、基金份额的停复牌和终止上市交易

上市基金份额的停复牌和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关规定所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，而无需召开基金份额持有人大会审议。届时，基金管理人需按照非上市的开放式指数基金调整相应的业务规则，并提前公告。

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，基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

五、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在其他证券交易所（含境外证券交易所）上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

六、法律法规、监管部门和深圳证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定，且此项调整无须召开基金份额持有人大会。

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

## 第十部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

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业务。基金管理人在开始办理申购、赎回业务前公示申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回，具体申购、赎回业务办理时间在申购、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》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记机构确认接受的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回申请，并按照下一开放日的申请处理。

### 三、申购与赎回的原则

- 1、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、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、赎回应遵守业务规则的规定。
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许并在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按申购赎回代理券商规定的方式依照申购赎回清单备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

## 2、申购和赎回申请的确认

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。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，则赎回申请失败。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

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

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金组合证券、基金份额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。基金托管人根据登记机构的结算通知和基金管理人的划款通知办理资金的划拨。

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

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

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

基金管理人、深圳证券交易所、登记机构可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质性利益的前提下，对基金份额申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，基金管理人应最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购与赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。目前，本基金最小申购赎回单位为 100 万份。基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素，对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购与赎回的对价、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。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理



人应交付的组合证券、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，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用，具体请参见招募说明书或相关公告。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。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。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间进行调整并提前公告。

## 七、申购赎回清单的内容与格式

### 1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金差额、T-1日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

### 2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

### 3、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。

### 4、现金替代相关内容

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

(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”）。

对于深圳证券交易所上市的成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于上海证券交易所上市的成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，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。

可以现金替代适用于所有成份股。

对于标志为可以现金替代的深圳证券交易所上市的成份股，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。

对于标志为可以现金替代的上海证券交易所上市的成份股，申购赎回基金份额时，均使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有成份股，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

可以现金替代的组合证券分为：深圳证券交易所成份证券和上海证券交易所成份证券。

##### 1) 关于深圳证券交易所成份证券可以现金替代的情形

①适用情形：投资者申购时持仓不足的深圳证券交易所成份证券。登记机构先用深圳证券交易所成份证券，不足时差额部分用现金替代。

②替代金额：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该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例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买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买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序如下：

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此在 T+1 日收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（即 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的成份证券。

T+2 日日终，若基金管理人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买入成本（包括买入价格和交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人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的实际买入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券的正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后的第 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应补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

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

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

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。

## 2) 关于上海证券交易所成份证券可以现金替代的情形

①适用情形：投资者申购和赎回时的上海证券交易所成份证券。登记机构对设置可以现金替代的上海证券交易所成份证券全部用现金替代。

### ②替代金额：

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

赎回的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 - 赎回现金替代折价比例)。

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

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。

申购时收取申购现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取申购替代金额。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（包括买入价格与交易费用），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（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

赎回时扣除赎回现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回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赎回现金替代折价比例，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

③替代金额的处理程序如下：

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的成份证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的成份证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 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）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深圳证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在上海证券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上海证券交易所申报被替代证券的交易指令。

基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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，确定基金应退还申购投资者或申购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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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）、配股等权益变动，则进行相应调整。

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

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要设置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 日预估开盘价。

## 5、预估现金差额

预估现金差额指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

T 日预估现金差额在 T 日申购赎回清单中公告，其计算公式为：

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现金替代的固定替代金额总额 + 申购赎回清单中可以现金替代的所

有成份证券的数量与该证券参考价格乘积之和+申购赎回清单中禁止现金替代的所有成份证券的数量与该证券参考价格乘积之和)

其中,“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。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”需要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。

## 6、现金差额

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

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告,其计算公式为:

$$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额总额} + \text{申购赎回清单中可以现金替代的所有成份证券的数量与该证券 T 日收盘价乘积之和} + \text{申购赎回清单中禁止现金替代的所有成份证券的数量与该证券 T 日收盘价乘积之和})$$

T 日投资人申购、赎回的基金份额,需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。

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

## 7、申购赎回清单的格式

基金管理人有权根据业务需要对申购、赎回清单的格式进行修改。

申购赎回清单的格式举例如下:



基本信息	
最新公告日	
基金名称	
基金管理公司名称	
一级市场基金代码	
目标指数代码	
基金类型	
T-1 日信息内容	
现金差额（单位：元）	
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	
基金份额净值（单位：元）	
T 日信息内容	
预估现金部分（单位：元）	
可以现金替代比例上限	
申购上限	
赎回上限	
是否需要公布 IOPV	
最小申购赎回单位（单位：份）	
最小申购赎回单位现金红利	
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							
T 日成份股信息内容							
股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代保证金率 (%)	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购申请。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、因特殊原因（包括但不限于相关证券、期货交易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或无法进行证券交易。
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或基金管理人在开市后发现申购赎回清单编制错误或基金份额参考净值计算错误。
- 5、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。
- 6、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。

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

8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金登记结算系统或基金会计系统无法正常运行。

9、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购份额上限，当一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申购份额超过申购赎回清单中规定的申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝。

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

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一（第 6、9 项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### **九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价或无法受理投资人的赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、因特殊原因（包括但不限于相关证券、期货交易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或无法进行证券交易。

4、相关证券交易所、登记机构、申购赎回代理券商等因异常情况无法办理赎回业务。

5、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或基金管理人在开市后发现基金份额参考净值计算错误。

6、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

7、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。

8、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回份额上限，当一笔新的赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝。

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

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一（第 8 项除外）且基金管理人决定暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价时，基金管理人应根据有关规定报中国证监会备案，并在规定媒介上刊登暂停赎回公告。已确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、其他申购赎回方式

1、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况履行适当程序后开通本基金的场外申购赎回

等业务，无需召开基金份额持有人大会。场外申购赎回的具体办理方式、业务办理规则等相关事项届时将另行公告。

2、若基金管理人推出本基金的ETF联接基金，在本基金上市之前，ETF联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

3、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

4、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，集合申购业务的相关规则由基金管理人制定并依照《信息披露办法》的有关规定及时公告。

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

#### **十一、基金的非交易过户等其他业务的办理**

基金登记机构可根据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并按照规定收取一定的手续费用。

**十二、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。**

## 第十一部分 基金的投资

### 一、投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等）、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

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

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

### 三、投资策略

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

#### 1、完全复制策略

本基金主要采取完全复制法，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。

#### 2、替代性策略

当预期指数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，基金管理人将通过投资非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

#### 3、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货时，将严格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。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保

值操作，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。

#### 5、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金管理人将通过对宏观经济运行趋势及财政货币政策变化的研究分析，以定量辅助手段预测未来市场利率趋势及利率期限结构的变化，综合运用久期控制、期限结构配置、类属配置等多种投资策略进行个券选择。

#### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

#### 7、融资和转融通证券出借业务策略

本基金还可以参与融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：



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

(2) 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%；

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

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

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

(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，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；

(8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

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

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

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

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

6) 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(10) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

(12) 本基金在最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元的前提下，可以参与转融通证券出借业务，并应当遵循以下限制：

1) 本基金出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围内；

2) 本基金参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

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

(13) 本基金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；

(14) 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；

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(6)、(12)、(13)、(14)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(12)条规定的,基金管理人不得新增出借业务。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

## 五、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为国证新能源车电池指数，业绩比较基准为国证新能源车电池指数收益率。

国证新能源车电池指数反映 A 股市场中新能源车电池产业上市公司的市场表现。

### 1、指数样本空间

在深圳、上海证券交易所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；
- 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；
- 6、公司业务领域属于涉及新能源车电池（正极材料、负极材料、电解液、隔膜等）、新能源车电池管理系统及新能源车充电桩等。

### 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 50 名股票作为指数样本股，样本数量不足则按实际数量纳入。

投资者可通过深圳证券信息有限公司网站（<http://www.cnindex.com.cn>）查询本基金标的指数的具体信息。

如果发生上述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），或指数编制机构退出等情形，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过召开基金份额持有人大会审议变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

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

若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）且在不损害持有人利益的前提下，在履行适当程序后，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，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。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 第十二部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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



允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

（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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值

日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

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、本基金投资股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8、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。

9、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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负责赔付。

## 五、估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值

错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

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

## 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 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，或证券/期货交易所、登记结算机构等第三方机构发送的数据错误等，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益分配原则

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

2、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

3、《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定与基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 二、收益分配方案

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

### 三、收益分配方案的确定、公告与实施

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

### 四、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户开户及维护费用；
- 9、基金的上市初费和年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，托管人按照双方约定的时间，自动在次月按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具划款



指令，支付时间及收款账户信息由基金管理人通过书面形式另行通知托管人。  
若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、上述“一、基金费用的种类”中第 3—10 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。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

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

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

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

## 第十七部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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、恭维性或推荐性文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、基金份额发售公告

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，基金招募说明书、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招募说明书、基金产品资料概要。

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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

#### （二）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。

#### （三）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依照《信息披露办法》的有关规定将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

#### （四）基金份额上市交易公告书

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

#### （五）基金净值信息

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

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

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

#### （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，通过规定媒介公告当日的申购赎回清单。

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、

报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### （八）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、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、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人高级管理人员、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；
- 11、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、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 19、本基金变更标的指数；
- 20、基金份额暂停、恢复、终止上市交易；
- 21、本基金实施基金份额折算；
- 22、本基金调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申赎对价组成；
- 23、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；
- 24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

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

#### （十）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。

#### （十一）清算报告

基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十二）股指期货的投资情况

本基金若投资股指期货，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、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）参与融资及转融通证券出借业务的情况

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

#### （十四）资产支持证券的投资情况

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

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

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

基金管理人、基金托管人除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相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致决定暂停估值的；
- 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它情况。

## 第十八部分 风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

### 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。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。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、信用风险。基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

6、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。

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

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

9、债券回购风险。较高的债券正回购比例可能增加组合的流动性风险和利率风险。

## 二、管理风险

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

## 三、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记结算系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## 四、流动性风险

### 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 100 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基金将在深圳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、拟投资市场、行业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其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括存托凭证）、股指期货、债券、货币市场工具（包括银行存款、同业存单、债券回购等）、资产支持证券等。投资交易均在依法设立的正规市场中进行，所投市场和资产方面的整体流动性较高。同时，本基金通过投资限制对各类资产的投资比例、期限、评级、杠杆和集中度进行了控制，并严格控制了主动投资于流动性受限资产的比例上限，整体持仓资产的流动性风险较低。

## 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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回对价支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

## 五、本基金特有风险

本基金为指数基金，投资者可能面临基金跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等潜在风险。

(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

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标的指数成份股派发现金红利将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

④由于成份股停牌、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。

⑤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。

⑥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。

⑦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）标的指数终止或变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现终止或因终止需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）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。

#### （6）基金份额参考净值（IOPV）计算错误的风险

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向深圳证券交易所发送，由深圳证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。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，需投资者自行承担。

#### （7）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。

#### （8）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，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

#### （9）投资者赎回失败的风险

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### （10）基金赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券，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，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

#### （11）申购赎回清单标识设置风险

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

#### （12）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，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第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### （13）投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证，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。

#### （14）投资股指期货的风险

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

#### （15）投资资产支持证券的风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### （16）融资及转融通证券出借业务风险。

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；（2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

此外，本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务，可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

## 六、其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

2、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

5、其他意外导致的风险。

## 七、声明

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

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构代理销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，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、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会

备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规的规定。

## 第二十部分 基金合同摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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



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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或股票、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、证券交易所、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规定的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规定的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(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，为基金的利益依法进行融资、融券及转融通证券出借业务；

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

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

(16) 在符合有关法律、法规、《基金合同》、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的前提下，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回及其他相关业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、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，确定基金份额申购对价、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、中期和年度基金报告；

(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，向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规的规定；

(17) 确保需要向基金投资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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；投资者以股票认购的，相关股票的解冻按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》的规定处理；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

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

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

(12) 保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

本基金联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和 ETF 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 ETF 联接基金的基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，ETF 联接基金的基金份额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，ETF 联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的 ETF 联接基金份额占 ETF 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。

ETF 联接基金的基金管理人不应以 ETF 联接基金的名义代表 ETF 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 ETF 联接基金的特定基金份额持有人的委托以 ETF 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。

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

#### （一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；



(12) 终止基金上市，但因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除外；

(13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整份额类别设置、停止现有基金份额类别的销售或者增设本基金的基金份额类别，但需履行相关程序；

(3) 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业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(5) 基金管理人、销售机构、证券交易所、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、收益分配、非交易过户等业务的规则；

(6) 调整基金的申购赎回方式（如增加场外申赎）及申购对价、赎回对价组成；

(7) 调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；

(8) 基金管理人在履行相关程序后推出新业务或服务；

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额

持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之

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

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行；基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

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

### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开的事由、召开条件、议事程序和表决条件等内容，凡是直接引用法律法规或监管规定的部分，如法律法规或监管规定修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对该部分内容进行修改或调整，无需召开基金份额持有人大会。



### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

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

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

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

#### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，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、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规的规定。

#### 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，各方当事人应尽量通过协商、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上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用、律师费用根据仲裁裁决承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本合同之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 第二十一部分 托管协议摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：中银国际证券股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：中国上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

邮政编码：200120

法定代表人：宁敏

成立日期：2002 年 2 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字【2002】19 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：27.78 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；融资融券；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务；为期货公司提供中间介绍业务。

#### （二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券等）、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

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

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

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

(2) 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%；

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

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

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

(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，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；

(8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

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

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

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

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

6) 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(10) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

(12) 本基金在最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元的前提下，可以参与转融通证券出借业务，并应当遵循以下限制：

1) 本基金出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围内；

2) 本基金参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

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

(13) 本基金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；

(14) 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；

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（6）、（12）、（13）、（14）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（12）条规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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

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

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。



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

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本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。

在基金合同生效后 2 个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

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

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

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

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

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

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

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付，以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

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

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

6.基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

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

(2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》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提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,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,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。

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

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

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

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

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

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

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

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

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

#### 四、基金财产保管

##### （一）基金财产保管的原则

1.基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

2.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人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。

3.基金托管人按照规定开立基金财产的银行存款账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，基金管理人和基金托管人按照规定开立期货资金账户。

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

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

##### （二）基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）规定的会计师事务所

进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1.基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

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

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

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

5.基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

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责任公司开立证券账户。

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。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

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即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

对于深交所上市的 ETF 基金，基金托管人以产品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，专门用于办理投资人通过证券交易所认、申购本基金所涉及的资金结算业务。结算备付金账户的资金交收按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1.基金合同生效后，基金管理人负责向中国人民银行进行报备，基金托管人在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

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

#### （六）期货相关账户的开立和管理

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

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

#### （七）基金投资银行存款账户的开立和管理

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



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

为防范特殊情况下的流动性风险，存款协议中应当约定提前支取条款。

#### （八）其他账户的开立和管理

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

（九）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

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

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

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

#### （十）与基金财产有关的重大合同的保管

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

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

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。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净值，以约定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，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人对外公布。

本基金按以下方法估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

(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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方

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

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、本基金投资股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8、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。

9、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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负责赔付。

## （二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人或基金先行支付赔偿。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

1.如采用本协议第八章“（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第 1—7、9 项进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率与托管费率的比例各自承担相应的责任；

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

3.基金管理人、基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

### （三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### （四）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### （五）会计数据和财务指标的核对

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

### （六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报告的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；基金合同生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，基金招募说明书、基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书、基金产品资料概要。中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 2 个月内公告；年度报告在会计年度结束后 3 个月内公告。如果基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或以双方约定的其他方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书、基金产品资料概要等，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

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

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

(三) 基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

(四) 除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限不低于法律法规的规定。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。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海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，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用、律师费用根据仲裁裁决承担。

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，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律（为本协议之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### (一) 基金托管协议的变更



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。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

(二) 基金托管协议的终止

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

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权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，基金管理人不承担相关责任。

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送及发送服务

#### 1、交易确认单

每次交易结束后，投资者应及时通过销售机构的网点查询或打印交易确认单。

#### 2、电子对账单

基金管理人提供月度、季度、年度电子邮件对账单及月度、季度手机短信对账单服务，基金管理人将以电子邮件形式向定制的投资者定期发送。投资者可通过基金管理人网站（www.bocifunds.com）、客服热线（021-61195566 / 400-620-8888（免长途通话费）选择 6 公募基金业务转人工）、客服邮箱（gmkf@bocichina.com）等途径申请/取消对账单服务。

### 二、网上在线服务

（一）通过基金管理人基金网站（www.bocifunds.com），投资者可获得如下服务：

#### 1、查询服务

投资者通过基金账户号、身份证号等开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站“基金查询”栏目，可享有基金交易查询、账户查询和基金信息查询服务。

#### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取本基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、业绩报告和基金管理人最新动态等各类最新资料。

### 三、信息定制服务

投资者可以通过基金管理人基金网站（www.bocifunds.com）、客服热线（021-61195566 / 400-620-8888（免长途通话费）选择6公募基金业务转人工）提交信息定制申请，基金管理人通过电子邮件或手机短信定期发送所定制的信息。

- 1、电子邮件：基金份额净值、电子邮件对账单、各类电邮资讯等。
- 2、手机短信：基金份额净值、手机短信对账单、各类短信资讯等。

### 四、账户资料变更服务

为便于投资者及时得到基金管理人提供的各项服务，请投资者及时更新服务联系信息。投资者可通过以下3种方式进行服务联系信息（包括联系地址、手机号码、固定电话、电子邮箱等）的变更。基金管理人电子直销投资者交易联系信息的变更，请遵照基金管理人电子直销相关规定办理：

- 1、登录基金管理人基金网站“账户管理”（仅限基金管理人电子直销投资者）系统自助修改联系信息。
- 2、致电基金管理人客服热线021-61195566 / 400-620-8888（免长途通话费）选择6公募基金业务转人工修改。
- 3、发送邮件至基金管理人客服邮箱gmkf@bocichina.com提交修改申请。

### 五、客户服务中心电话服务

投资者拨打基金管理人客服热线021-61195566 / 400-620-8888（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品等自助查询服务。

2、人工服务时间：每个证券交易日的08:30—17:30。投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

## 六、客户投诉及建议受理服务

投资者可以通过基金管理人客服热线、书信、电子邮件、传真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。

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

## 第二十三部分 其他应披露事项

本基金暂无其他应披露事项。《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

### （一）备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

### （二）存放地点

除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

### （三）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。

中银国际证券股份有限公司

2021 年 11 月 9 日