

浦银安盛基金管理有限公司

浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金

招募说明书

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇二一年十二月

重要提示

本基金的募集申请已于 2021 年 6 月 28 日经中国证监会证监许可〔2021〕2243 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监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资者在投资本基金前，需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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、流动性风险、法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其他风险等。

本基金标的指数为中证沪港深消费龙头指数，具体如下：

1、样本空间

中证沪港深消费龙头指数样本空间由沪深市场证券和香港市场证券组成。

沪深市场证券的样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

(1) 科创板证券：上市时间超过一年。

(2) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

香港市场证券的样本空间由港股通范围内的证券组成。

2、选样方法

(1)对样本空间内的沪深市场证券,按照过去一年日均成交金额由高到低排名,剔除排名后 20%的证券;对样本空间内的香港市场证券,剔除过去一年日均成交金额不足 3000 万港元的证券;

(2)对样本空间内剩余证券,根据上市公司业务特点选取饮料与烟草、食品加工、农产品、纺织服装、个人用品、零售、消费服务和家庭耐用消费品等消费领域证券作为消费主题空间;

(3)在消费主题空间中,选取同时满足以下条件的证券作为待选样本:

1) 过去两年经营活动现金流量净额 TTM 均为正;

2) 过去两年 ROE TTM 降序排名均处于消费主题空间内证券的前 3/4,且处于各细分消费领域的前 1/2;

3) 过去三年净利润的增长率为正;

4) 市盈率的倒数大于 0 且降序排名处于细分消费领域内的前 90%;

在进行筛选时,对于营业收入 TTM 降序排名处于细分消费领域内前 10%且过去三年营业收入增长率降序排名处于细分消费领域内前 20%的证券,豁免以上筛选条件;

(4)根据上述待选样本在各细分消费领域内的数量分布,确定各细分消费领域最终入选样本数量,确定方法如下:

$$\text{第 } i \text{ 个细分消费领域入选样本数量 } N_i = \text{Max}(\text{round}(\frac{M_i}{\sum M_i} * 50), 3)。$$

其中, N_i 表示各细分消费领域入选的证券数量, round 表示四舍五入取整; M_i 表示待选样本中该细分消费领域的证券数量。

(5)在待选样本中,根据过去一年日均公司总市值、营业收入 TTM、净利润 TTM 三个指标分别计算升序百分比排名,将三项指标排名的算术平均值作为综合得分。在各细分消费领域内,依据已确定的样本数量选取综合得分较高的证券,若同一家公司的沪深市场证券和香港市场证券同时入选,则仅纳入市值较大的证券类别。若指数样本数量不足或超过 50 只,做进一步调整以使样本数量等于 50,同时保证各细分领域入选证券数量不低于 3 只。

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

本基金跟踪中证沪港深消费龙头指数，本基金特有的风险包括但不限于：指数化投资的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、成份股停牌的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离或跟踪误差控制未达约定目标的风险、投资港股通标的股票的投资风险、标的指数变更或不符合要求以及指数编制机构退出或停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金退市风险、投资者申购失败的风险、基金份额持有人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置风险、退补现金替代方式的风险、投资于股指期货可能引致的特定风险、投资于资产支持证券可能导致的特定风险、非公开发行股票等流通受限证券的投资风险、第三方机构服务的风险、参与转融通证券出借业务的风险等。

本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金可投资于股指期货，股指期货作为金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是盯市结算风险、交易对手风险和基差风险。

本基金可能投资于资产支持证券。本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，可能造成基金财产损失。此外，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，从而对基金收益造成影响。

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：信用风险、市场风险及其他风险。

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证沪港深消费龙头指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所基金账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易；如投资者需要使用本基金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或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用本基金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，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

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

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	21
第五部分 相关服务机构	25
第六部分 基金的募集	27
第七部分 基金合同的生效	36
第八部分 基金份额折算与变更登记	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	59
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 基金费用与税收	75
第十五部分 基金的收益与分配	77
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	88
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	99
第二十部分 基金合同的内容摘要	101
第二十一部分 基金托管协议内容摘要	126
第二十二部分 对基金份额持有人的服务	146
第二十三部分 其他应披露事项	148
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式	149
第二十五部分 备查文件	150

第一部分 绪言

《浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）由浦银安盛基金管理有限公司依据《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》和其他有关法律法规的规定以及《浦银安盛中证沪港深消费龙头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。

本招募说明书阐述了浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的《基金合同》编写，并经中国证监会注册。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、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》、《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》。

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

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：指浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指浦银安盛基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同或合同：指《浦银安盛中证沪港深消费龙头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《浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《浦银安盛中证沪港深消费龙头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
- 9、上市交易公告书：指《浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出

的修订

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会第 166 号令《关于修改部分证券期货规章的决定》修订的《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《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”（Exchange Traded Fund）

17、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，紧密跟踪标的指数，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

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》（包括其不时修订）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、特定机构投资者：指上海证券交易所发布的《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》（及其不时做出的修订）所定义的特定机构投资者

26、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

27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

28、销售机构：指浦银安盛基金管理有限公司以及经中国证监会或者其派出机构注册，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

29、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

30、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

31、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人相关账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

32、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为浦银安盛基金管理有限公司或接受浦银安盛基金管理有限公司委托代为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

33、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

34、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

35、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

- 36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 38、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
- 39、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
- 40、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（本基金的开放日为港股通、上海证券交易所、深圳证券交易所同时正常开放交易的工作日）
- 41、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
- 42、《业务规则》：指浦银安盛基金管理有限公司、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金销售机构的相关业务规则、规定、通知、指南及其不时做出的修订
- 43、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
- 44、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
- 45、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转换为基金合同所规定对价的行为
- 46、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
- 47、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
- 48、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
- 49、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证沪港深消费龙头指数及其未来可能发生的变更
- 50、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
- 51、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金份额数应为最小申购、赎回单位的整数倍

52、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

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

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

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

56、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

57、元：指人民币元

58、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

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

60、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）

61、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）

62、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

63、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

64、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

65、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

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

67、**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

68、**规定媒介**：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）以及《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

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

70、**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

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

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：浦银安盛基金管理有限公司（简称：本公司）

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

法定代表人：谢伟

设立日期：2007 年 8 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：191,000 万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-23212888

二、主要人员情况

（一）董事会成员

谢伟先生，董事长，同济大学工学硕士研究生，高级经济师。曾任中国建设银行郑州分行金水支行副行长，河南省分行公司业务部总经理，许昌市分行党委书记、行长；上海浦东发展银行公司及投资银行总部发展管理部总经理，公司及投资银行总部副总经理兼投行业务部、发展管理部、大客户部总经理，上海浦东发展银行福州分行党委书记、行长，上海浦东发展银行资金总部总经理，上海浦东发展银行金融市场业务总监兼金融市场部总经理、资产管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长、董事会秘书，兼任金融市场业务总监。自 2017 年 3 月起兼任本公司董事，自 2017 年 4 月起兼任本公司董事长。

Bruno Guilloton 先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺美术学院。于 1999 年加盟安盛投资管理（巴黎）公司，担任股票部门主管。2000 年至 2002 年，担任安盛投资管理（东京）公司首席执行官。2002 年，任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005 年起，担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。2009 年起任安盛投资管理公司亚洲股东代表。现任安盛投资管理公司亚太区 CEO。自 2015 年 2 月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。现另兼任 Foch Saint Cloud Versailles Sci 及 Fuji Oak Hills 公司

董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。2016 年 12 月至 2021 年 3 月兼任安盛投资管理（上海）有限公司董事长。

丁蔚女士，董事，上海交通大学工商管理硕士研究生，高级经济师。曾任中国建设银行上海市分行龙卡业务处理中心主任助理、副主任，个人银行业务部副总经理；上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部负责人、总经理，个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理，电子银行部（移动金融部）总经理，零售业务部总经理、零售业务工作党委副书记。现任上海浦东发展银行党委委员、零售业务总监、零售业务党委副书记、零售业务部总经理。2021 年 1 月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。1999 年加盟安盛罗森堡投资管理公司，先后担任亚太区 CIO 和 CEO，安盛罗森堡日本公司 CIO。2010 年任命为安盛-Kyobo 投资管理公司 CEO。2012 年起担任安盛投资管理公司亚洲业务发展主管。自 2012 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司监事。2016 年 12 月至 2021 年 3 月兼任安盛投资管理（上海）有限公司总经理（法定代表人）。

陈颖先生，董事，复旦大学公共管理硕士，律师、经济师。1994 年 7 月参加工作。1994 年 7 月至 2013 年 10 月期间，陈颖同志先后就职于上海市国有资产管理办公室历任科员、副主任科员、主任科员，上海久事公司法律顾问，上海盛融投资有限公司市场部副总经理，上海国盛（集团）有限公司资产管理部副总经理、执行总经理，上海国盛集团地产有限公司总裁助理。2013 年 10 月起就职于上海国盛集团资产有限公司，现任上海国盛集团资产有限公司党委副书记、执行董事、总裁。2018 年 3 月起兼任本公司董事。

刘长江先生，董事。北京师范大学教育管理专业硕士研究生，经济师。曾任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长。2003 年 4 月进入浦发银行，历任总行基金托管部总经理，总行公司及投资银行总部资产托管部总经理兼企业年金部、期货结算部总经理，总行公司及投资银行总部副总经理兼资产托管部、企业年金、期货结算部总经理，总行金融机构部总经理兼总行资产托管部总经理、总行第一直属党委委员，总行金融机构部总经理兼总行资产管理部（资产管理中心）总经理、总行金融市场业务党委副书记。现任浦发银行总行资产管理部（资产管

理中心) 总经理、总行金融市场业务党委副书记。2021 年 11 月起兼任本公司董事。

郁蓓华女士，董事，总经理，复旦大学工商管理硕士。自 1994 年 7 月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自 2012 年 7 月起担任本公司总经理。自 2013 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月至 2017 年 2 月兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。2017 年 2 月至 2021 年 11 月兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

韩启蒙先生，独立董事。法国岗城大学法学博士。1995 年 4 月加盟基德律师事务所担任律师。2001 年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004 年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006 年 1 月至 2011 年 9 月，担任基德律师事务所全球合伙人。2011 年 11 月起至今，任上海启恒律师事务所合伙人。自 2013 年 2 月起兼任本公司独立董事。

霍佳震先生，独立董事，同济大学管理学博士。1987 年进入同济大学工作，历任同济大学经济与管理学院讲师、副教授、教授，同济大学研究生院培养处处长、副院长、同济大学经济与管理学院院长，现任同济大学经济与管理学院教师、BOSCH 讲席教授、东方日升新能源股份有限公司独立董事、上海同济科技实业股份有限公司监事会主席、上海交运集团股份有限公司独立董事。自 2014 年 4 月起兼任本公司独立董事。

董叶顺先生，独立董事。中欧国际工商学院 EMBA，上海机械学院机械工程学学士。现任火山石投资管理有限公司创始合伙人、上海和辉光电股份有限公司独立董事、上海新通联包装股份有限公司独立董事、上海沿浦金属制品股份有限公司独立董事。董叶顺先生曾任 IDG 资本投资顾问(北京)有限公司合伙人及和谐成长基金投委会成员，上海联和投资有限公司副总经理，上海联创创业投资有限公司、宏力半导体制造有限公司、MSN(中国)有限公司、南通联亚药业有限公司等公司董事长。董叶顺先生有着汽车、电子产业近 20 多年的管理经验，曾任上海申雅密封件系统、中联汽车电子、联合汽车电子系统、延峰伟世通汽车内饰系统等有限公司总经理、党委书记职务。自 2014 年 4 月起兼任本公司独立董事。

赵晓菊女士，独立董事，上海财经大学金融专业本科，上海社会科学院世经所博士。1973年参加工作。1983年2月起任职于上海财经大学金融学院，先后任助教，讲师，副教授，副院长，常务副院长。赵晓菊女士曾担任上海国际银行金融学院首任院长、执行董事。1999年6月至今任上海财经大学金融学院教授，博士生导师。2018年8月至2021年5月，担任上海国际金融中心研究院院长。2021年5月至今，担任上海国际金融中心研究院荣誉院长兼研究院学术委员会常务副主任。自2021年9月起，担任上海仁达普惠金融发展研究基金会理事长。自2020年6月起，担任本公司独立董事。

（二）监事会成员

檀静女士，监事长，澳大利亚悉尼大学人力资源管理和劳资关系硕士研究生，加拿大不列颠哥伦比亚大学国际工商管理硕士。2010年4月至2014年6月就职于上海盛融投资有限公司，曾先后担任人力资源部副总经理，监事。2011年1月起至今就职于上海国盛集团资产管理有限公司任行政人事部总经理。自2015年3月起兼任本公司监事长。

Fabien Malazdra 先生，监事，尼斯大学金融工程学士，拥有15年法律合规及尽职调查方面的丰富经验。2006-2007年期间，任法盛资产管理公司（Natexis Asset Square）对冲基金尽职调查分析师。2007-2013年期间，任摩根芒萨尔投资公司（JPMorgan Mansart Investments）尽职调查副主管。2013年加入安盛投资管理有限公司，历任合规顾问、合规经理，2018年8月起至今，任安盛投资管理有限公司亚太区合规总监。2021年11月起兼任本公司监事。

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年；2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于2010年12月起担任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2012年3月担任本公司职工监事。2012年5月起，担任浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理。2017年4月起，担任浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018年9月起，担任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年1月起，担任浦银安盛

中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年4月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年6月起，担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年9月起，担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021年5月起，担任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。2021年7月起担任浦银安盛中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年11月起，担任浦银安盛中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金和浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金基金经理。

朱敏奕女士，本科学历。2000年至2007年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户主管。2007年4月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理，现任本公司市场部总监。自2013年3月起，兼任本公司职工监事。

（三）公司总经理及其他高级管理人员

郁蓓华女士，复旦大学工商管理硕士。自1994年7月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自2012年7月23日起担任本公司总经理。自2013年3月起，兼任本公司董事。2013年12月至2017年2月兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。2017年2月至2021年11月兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

喻庆先生，中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历，中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007年8月起，担任本公司督察长。

李宏宇先生，西南财经大学经济学博士。1997年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007年3月起加盟本公司，历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自2012年5月2日起，担任本公司副总经理

兼首席市场营销官。

汪献华先生，上海社会科学院政治经济学博士。曾任安徽经济管理干部学院经济管理系教师；大通证券资产管理部固定收益投资经理；兴业银行资金营运中心高级副理；上海浦东发展银行货币市场及固定收益部总经理；交银康联保险人寿有限公司投资部总经理；上海浦东发展银行金融市场部副总经理。2018年5月30日起，担任本公司副总经理。2019年2月至2020年3月，兼任本公司固定收益投资部总监。

邓列军先生，清华大学工程硕士。曾在汇添富基金管理有限公司先后任职信息技术部 IT 高级经理、信息技术部总监助理、信息技术部副总监、信息技术部总监。2020年3月加盟浦银安盛基金管理有限公司，2020年7月起担任本公司首席信息官。2021年11月起担任本公司副总经理兼首席信息官。

（四）本基金基金经理

高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010年10月至2014年3月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014年3月至2018年10月在中国工商银行总行贵金属业务部工作，历任产品研发经理、代客交易经理。2018年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，参与ETF业务筹备工作。2019年3月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年7月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年9月起担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021年7月起担任浦银安盛中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年9月起担任浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年11月起担任浦银安盛中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金基金经理。高钢杰先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

（五）投资决策委员会成员

1、权益投资决策委员会

郁蓓华女士，本公司总经理，董事。

李宏宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。

汪献华先生，本公司副总经理。

吴勇先生，本公司投资总监兼权益投资部总监，基金经理。

楚天舒女士，本公司首席指数量化官。

陈士俊先生，本公司指数与量化投资部总监，基金经理，本公司职工监事。

蒋佳良先生，本公司研究部总监兼均衡策略部总经理，基金经理。

督察长、FOF 业务部负责人、风险管理部负责人、集中交易部负责人、权益投资基金经理和基金经理助理列席权益投资决策委员会会议。

2、固定收益投资决策委员会

郁蓓华女士，本公司总经理，董事。

李宏宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。

汪献华先生，本公司副总经理。

李羿先生，本公司固定收益投资部副总监，基金经理。

涂妍妍女士，本公司信用研究部副总监。

督察长、风险管理部负责人、集中交易部负责人、相关交易人员及投资人员列席固定收益投资决策委员会会议。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（一）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；

（二）办理基金备案手续；

（三）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；

（四）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（七）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；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

- (九) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (十) 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；
- (十一) 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；
- (十二) 中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

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

- 1、将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；
- 3、利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

(三) 本基金管理人承诺加强员工管理和培训，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利益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权；
- 7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

8、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

9、贬损同行，以抬高自己；

10、以不正当手段谋求业务发展；

11、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

13、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

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

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

（一）内部控制概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的有机系统。

内部控制是由为保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度构成的统一整体。

内部控制是由基金管理人的董事会、管理层和员工共同实施的合理保证。基金管理人的内部控制要达到的总体目标是：

1、保证基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；

2、防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

- 3、确保基金、基金管理人财务和其他信息真实、准确、完整、及时；
- 4、确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

（二）内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

1、控制环境

控制环境是内部控制其他要素的基础，它决定了基金管理人的内部控制基调，并影响着基金管理人内部员工的内控意识。为此，基金管理人从两方面入手营造一个好的控制环境。首先，从“硬控制”来看，本基金管理人遵循健全的法人治理结构原则，设置了职责明确、相互制约的组织结构，各部门有明确的岗位设置和授权分工，操作相互独立。其次，基金管理人更注重“软控制”，基金管理人的管理层牢固树立内部控制和风险管理优先的理念和实行科学高效的运行方式，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，加强全体员工道德规范和自身素质建设，使风险意识贯穿到基金管理人的各个部门、各个岗位和各个环节。

2、风险评估

本基金管理人的风险评估和管理分三个层次进行：第一层次为公司各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部的风险管理；第三层次为公司董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长和内部审计。

3、控制活动

本基金管理人制定了各项规章制度，通过各种预防性的、检查性的和修正性的控制措施，把控制活动贯穿于基金管理人经营活动的始终，尤其是强调对于基金资产与基金管理人的资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；严格岗位分离，明确划分各岗位职责，明确授权控制；对重要业务部门和岗位进行了适当的物理隔离；制订应急应变措施，危机处理机制和程序。

4、信息沟通

本基金管理人建立清晰、有效的垂直报告制度和平行通报制度，以确保识别、

收集和交流有关运营活动的关键指标,使员工了解各自的工作职责和基金管理人的各项规章制度,并建立与客户和第三方的合理交流机制。

5、内部监控

督察长、审计部、法律合规部负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制以及公司内部控制制度的执行情况,保证内部控制制度的落实。各部门必须切实协助经营管理层对日常业务管理活动和各类风险的总体控制,并协助解决所出现的相关问题。按照基金管理人内部控制体系的设置,实现一线业务岗位、各部门及其子部门根据职责与授权范围的自控与互控,确保实现内部监控活动的全方位、多层次的展开。

(三) 内部控制原则

1、健全性原则:内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并贯穿于到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

2、有效性原则:通过科学的内部控制手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内部控制制度的有效执行;

3、独立性原则:各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离;

4、相互制约原则:部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡;

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

(四) 内部控制机制

内部控制机制是指基金管理人的组织结构及其相互之间的制约关系。内部控制机制是内部控制的重要组成,健全、合理的内部控制机制是基金管理人经营活动得以正常开展的重要保证。

从功能上划分,基金管理人的内部控制机制可分为“决策系统”、“执行系统”、“监督系统”三个方面。监督系统在各个内部控制层次上对决策系统和执行系统实施监督。

决策系统是指在基金管理人经营管理过程中拥有决策权力的有关机构及其之间的关系。执行系统是指具体负责将基金管理人决策系统的各项决议付诸实现的一些职能部门。

执行系统在总经理执行委员会的直接领导下，承担了公司日常经营管理、基金投资运作和内部管理工作。

监督系统对基金管理人的决策系统、执行系统进行全程、动态的监控，监督的对象覆盖基金管理人经营管理的全部内容。基金管理人的监督系统从监督内容划分，大致分为三个层次：

- 1、监事会——对董事、高管人员的行为及董事会的决策进行监督；
- 2、董事会专门委员会及督察长、内部审计——根据董事会的授权对基金管理人的经营活动进行监督和评价；
- 3、审计部——根据总经理及督察长的安排，对基金管理人的经营活动及各职能部门进行内部监督和检查。

（五）内部控制层次

1、员工自律和部门主管的监控。所有员工上岗前必须经过岗位培训，签署自律承诺书，保证遵守国家的法律法规以及基金管理人的各项管理制度；保证良好的职业操守；保证诚实信用、勤勉尽责等。基金管理人的各部门主管在权限范围之内，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定、基金管理人的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任；

2、管理层的控制。管理层采取各种控制措施，管理和监督各个部门和各项业务进行，以确保基金管理人运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任；

3、董事会及其专门委员会的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合董事会及其专门委员会对各项业务和工作行为的检查监督。合理的风险分析和管理建议应予采纳，基金管理人规定的风险控制措施必须坚决执行。董事会对内部控制负最终责任；

4、督察长、审计部负责对基金管理人内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的检查和评价。

（六）内部控制制度

内部控制制度是指规范公司内部控制的系列规章制度和业务规则、流程，是公司内部控制的重要组成部分。公司为执行内部控制措施以实现内部控制目标，

在法律法规和行业监管规章有关规定的基礎上，制定了一套公司内部控制制度。公司内部控制制度从其制定的目的和适用范围分为两个大的层次：

1、《公司章程》——《公司章程》是具有法律约束力的纲领性文件，是规范公司的组织与行为、公司与股东之间以及股东相互之间权利和义务关系的基础，是确定公司与其他相关利益主体之间关系基本规则以及保证这些规则得到具体执行的依据。

2、内部控制制度包括以下几个方面：

(1) 内部控制大纲。内部控制大纲是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。内部控制大纲应经董事会的审阅与批准；

(2) 基本管理制度。基本管理制度主要根据相关法律法规，从规范公司管理和业务开展的角度出发，以业务为中心，就业务开展的目标、原则、过程、风险控制等方面作出规定，以指导各项业务的顺利开展。公司基本管理制度应经董事会的审阅与批准；

(3) 公司其他制度、部门规章和业务管理流程。公司其他制度、部门规章和业务管理流程主要在执行内部控制大纲和基本管理制度的基础上，以业务管理环节和部门管理为中心，对业务操作管理方法、具体流程及部门管理方法及岗位职责等作出明确和细化的规定，以规范部门内部和部门与部门之间、具体业务操作环节等工作的开展。公司其他制度、部门规章及业务管理流程应经公司管理层的审阅与批准。

(七) 基金管理人关于内部控制的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2020 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 7.89 万亿元，实现营业收入 2031.37 亿元，同比增长 12.04%，全年实现归属于母公司股东的净利润 666.26 亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

二、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2021 年 9 月 30 日，兴业银行共托

管证券投资基金 486 只，托管基金的基金资产净值合计 20121.17 亿元，基金份额合计 19181.86 亿份。

四、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照兴业银行相关制度对兴业银行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

（三）内部控制原则

1、全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

2、重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

3、独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

4、审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

5、制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

6、适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

（四）内部控制制度及措施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行

政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

(一) 发售协调人

具体名单详见基金份额发售公告。

(二) 网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

电话：(021) 23212899

传真：(021) 23212890

客服电话：400-8828-999；(021) 33079999

联系人：徐薇

网址：www.py-axa.com

(三) 网上现金发售代理机构、网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构详见基金份额发售公告及基金管理人网站。

二、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：于文强

联系人：赵亦清

电话：(010) 50938782

传真：(010) 50938991

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、李筱筱

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

联系人：赵珏

经办注册会计师：薛竞、赵珏

五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

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》、《基金合同》及其他有关规定募集。

本基金经中国证监会证监许可【2021】2243号文注册募集。

一、基金类型、运作方式和存续期限

基金类型：股票型、指数型证券投资基金

基金运作方式：交易型开放式

基金存续期限：不定期

二、基金的募集期限、发售方式、发售对象

1、募集期限

募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月，募集时间详见基金份额发售公告。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期，此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若经延长，最长不得超过前述募集期限。

2、发售方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。

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

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。

网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的具体安排详见基金份额发售公告的相关规定。

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。基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，在本基金基金份额发售公告或其

他公告中列明。基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告或相关公告。

基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金份额发售公告或基金管理人网站公示。若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司对发售方式、发售场所有所调整的，本基金将进行相应调整。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请，认购申请的成功确认应以登记机构在本基金募集结束后的登记确认结果为准。投资者可以在基金合同生效后到各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。投资者本人应主动及时查询认购申请的确认结果，因投资人未及时进行查询而造成的后果由其自行承担。

3、发售对象

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

三、认购开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所基金账户。

1、如投资者需新开立证券账户，则应注意：

(1) 上海证券交易所基金账户只能进行现金认购和二级市场交易；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进行网下股票认购或者进行基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则应同时开立上海证券账户和深圳证券交易所 A 股账户。

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

2、如投资者已开立证券账户，则应注意：

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

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

四、基金份额初始面值、认购价格、认购费用及计算公式

(一) 初始面值及认购价格:

本基金每份基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。基金份额的认购价格为 1.00 元。

(二) 认购费用:

认购费用或佣金由投资者承担, 认购费率不超过认购份额的 0.8%, 具体认购费率如下表所示:

认购份额 (S)	认购费率
$S < 50$ 万份	0.8%
50 万份 $\leq S < 100$ 万份	0.5%
$S \geq 100$ 万份	每笔交易 1,000 元

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、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

投资人多次认购, 须按每次认购所对应的费率档次分别计费。基金认购费用不列入基金财产, 主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

五、网上现金认购

1、认购时间: 详见基金份额发售公告, 具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

2、认购限额: 网上现金认购以基金份额申请。投资者应以上海证券账户认购, 单一账户每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍, 最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购, 累计认购份额不设上限, 但法律法规或监管要求另有规定的除外。

3、认购申请: 投资人在认购本基金时, 需按发售代理机构的规定, 备足认购资金, 办理认购手续。

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, 投资人应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

(1) 当认购佣金适用比例费率时，计算方法如下：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(2) 当认购佣金为固定金额时，计算方法如下：

认购佣金 = 固定费用

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式支付认购佣金。

例：某投资人到某发售代理机构网上现金认购 1,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则投资人需准备的认购金额计算如下：

认购金额 = $1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.80\%) = 1,008.00$ 元

认购佣金 = $1.00 \times 1,000 \times 0.80\% = 8.00$ 元

即投资人需准备 1,008.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

六、网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

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，单笔认购份额须为 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，单笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资人在募集期内可多次认购，单个投资人的累计认购规模没有限制，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

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

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。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投

投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后,通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后,登记机构进行清算交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

5、认购确认:在基金合同生效后,投资人应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

(1)通过基金管理人进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购费用和认购金额的计算如下:

1)当认购费用适用比例费率时,计算方法如下:

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

认购金额=认购价格×认购份额×(1+认购费率)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

2)当认购费用为固定金额时,计算方法如下:

认购费用=固定费用

认购金额=认购价格×认购份额+固定费用

净认购份额=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支付认购费用。

例:某投资人通过基金管理人直销柜台网下现金认购 100,000 份基金份额,认购费率为 0.80%。假定认购金额产生的利息为 10.00 元,则需准备的资金金额计算如下:

认购费用=1.00×100,000×0.80%=800.00 元

认购金额=1.00×100,000×(1+0.80%)=100,800.00 元

净认购份额=100,000+10.00/1.00=100,010 份

即投资人若通过基金管理人网下现金认购本基金 100,000 份,需准备 100,800.00 元资金,假定该笔认购金额产生利息 10.00 元,则投资人可得到 100,010 份本基金基金份额。

(2)通过发售代理机构进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购佣金和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计算。

七、网下股票认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，投资人通过基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。用以认购的股票必须是标的指数成份股或已公告的备选成份股中的上海证券交易所上市股票和深圳证券交易所上市股票（详见基金份额发售公告）。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

3、认购申请

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

4、特殊情形

(1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购开始日前 3 个月的个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前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，或长期停牌的个股，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) 募集结束前，如标的指数成份股出现调整，则调入名单中的股票将也纳入认购清单。

(5) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

5、清算交收

T 日日终（T 日为网下股票认购期最后一日），发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登

记结算有限责任公司深圳分公司的证券认购专户。基金管理人为投资者计算认购份额，以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人确认的认购申请股票数据，按照交易所和登记机构的规则和流程，将投资者申请认购的股票过户到本基金在上海证券交易所、深圳证券交易所开立的证券账户。基金合同生效后，登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

6、认购份额的计算公式

$$\text{投资人的认购份额} = \sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times$$

有效认购数量/1.00

其中：

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

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

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

1) 除息：调整后的价格 = 网下股票认购期最后一日的均价 - 每股现金股利或股息

2) 送股：调整后的价格 = 网下股票认购期最后一日的均价 / (1 + 每股送股比例)

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

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

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

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

(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。其中：

1) 对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

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

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

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

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

7、特别提示：投资人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。

八、募集期认购资金和股票的处理方式

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程予以冻结，冻结期间所产生的权益按照《业务规则》的有关规定处理。

九、募集期利息的处理方式

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

十、募集期间的费用

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

十一、发行联接基金或增设新的份额类别

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，或将旗下跟踪同一标的的指数的指数基金转型为本基金的联接基金，或为本基金增设新的份额类别，或开通场外申购、赎回相关业务并制定、公布相应的交易规则等，在履行适当程序后无需召开持有人大会审议。新的份额类别可设置不同的申购费、赎回费，具体规则等相关事项届时将另行公告。

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认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

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

二、基金合同不能生效时募集资金及股票的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票,登记机构应予以解冻,基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任;发售代理机构将协助基金管理人、登记机构完成相关资金和证券的退还工作;

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

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,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人民币5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，对投资人利益无实质性影响前提下，为了更好的跟踪标的指数，履行适当程序后，本基金可以进行份额折算。

一、基金份额折算的时间

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

二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。

如未来本基金增加基金份额的类别，基金管理人在实施份额折算时，可对全部份额类别进行折算，也可根据需要只对其中部分类别的份额进行折算。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除因尾数处理而产生的损益外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响，无需召开基金份额持有人大会审议。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登记机构遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的上市交易

一、基金份额的上市

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

- 1、场内基金资产净值不低于 2 亿元；
- 2、场内基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

二、基金份额的上市交易

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

三、上市交易的停复牌

本基金基金份额的停复牌按照《基金法》等相关法律法规的规定和上海证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

四、终止上市交易

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

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

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起后按照《信息披露办法》的规定发布基金份额终止上市交易公告。

若因上述 1、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式指数证券投资基金变更为跟踪同一标的指数的非上市的开放式指数基金，无需召开基金份额持有人大会。有关本基金转换基金运作方式的相关事项见基金管理人届时相关公告。届时，基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回业务规则。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

五、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，基金管理人或其委托的机构在开市后根据申购赎回清单、汇率和组合证券内各只证券的实时成交数据计算、并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。

基金份额参考净值（IOPV）的具体计算方法详见相关公告。

六、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，经基金管理人与基金托管人协商一致后，本基金在履行适当程序后可申请在包括境外交易所在内的其他交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

七、相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金按照新规定执行，若由此需要对基金合同及招募说明书相应予以修改的，此项修改无需召开基金份额持有人大会。

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

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。经基金管理人申请、上海证券交易所认可，特定机构投资者也可以直接向基金管理人申请办理基金申购赎回业务。

基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，在基金管理人网站公示。

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

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为港股通、上海证券交易所、深圳证券交易所同时正常开放交易的工作日，具体办理时间为开放日的正常交易时间；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/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金合同生效后，基金管理人在满足监管要求的情况下，根据本基金运作的需要决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金合同生效后，基金管理人在满足监管要求的情况下，根据本基金运作的需要决定本基金开始办理赎回的具体日期，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

三、申购与赎回的原则

1、本基金申购、赎回应遵守上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则 and 规定；

2、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；

3、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，具体以招募说明书及其更新为准；

4、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；

5、申购、赎回申请提交后不得撤销。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整，或依据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其变更调整上述规则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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。

投资人提交申购申请时，须根据申购赎回清单备足申购对价，否则所提交的申购申请无效。基金份额持有人提交赎回申请时，须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的赎回申请无效。

对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

2、申购和赎回申请的确认

正常情况下，投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。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的，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，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请及申购、赎回份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

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。

对于本基金申购业务涉及的基金份额、上海证券交易所上市的成份股及其现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代、港股通标的成份股的现金替代采用净额结算；对于本基金赎回业务涉及的基金份额、上海证券交易所上市的成份股及其现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，港股通标的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销、上海证券交易所上市的成份股的交收以及上海证券交易所及深圳证券交易所上市的成份股现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所及深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。赎回港股通标的成份股的现金替代款的清算交收由基金管理人和申购赎回代理券商协商处理，正常情况下，该款项的清算交收于 T+7 日（指开放日）内办理，但如果出现港股通暂停交易或交收、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则该款项的清算交收可延迟办理。

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

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进行处理。

如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

基金管理人和登记机构可在法律法规允许的范围内，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，并在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

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

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购赎回清单。基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资人需求等因素，对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。

2、基金管理人可设定当日申购份额上限和当日赎回份额上限，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，并在申购赎回清单中公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限以及投资人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

5、基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资人需求，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制或最小申购、赎回单位或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

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

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

基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对申购对价、赎回对价组成、基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并根据相关法规规定进行信息披露。

七、申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

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

2、组合证券相关内容

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

3、现金替代相关内容

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

现金替代分为4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”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

（1）禁止现金替代

适用于上海证券交易所上市的成份证券，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。

（2）可以现金替代

适用于上海证券交易所上市的成份证券，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。目前仅适用于标的指数中的上海证券交易所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

其中，“参考价格”为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

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

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价

格与交易费用)的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项;若未能购入全部被替代的证券,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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

若现金替代日(T 日)后至 T+2 日(若在特例情况下,则为 T 日起第 20 个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日(若在特例情况下,则为 T 日起第 21 个交易日),基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人,相关款项的清算交收将于此后的 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现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为:

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

其中:

“该证券参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化,以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。“参考基金份额净值”目前为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价,如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化,以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

(3) 必须现金替代

适用于所有成份证券,是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券必须使用固定现金作为替代。

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原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量、其调整后 T 日开盘参考价及最新估值汇率（如需）的乘积或基金管理人认为合理的其他方法。

（4）退补现金替代

适用于深圳证券交易所上市的成份证券及港股通标的成份证券，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，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。

适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数中深圳证券交易所上市的股票及港股通标的股票。

1) 深圳证券交易所股票

本部分“T+2 日”指 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日。

①替代金额：对于退补现金替代的深圳证券交易所上市的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × (1 + 现金替代溢价比例)；

赎回的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × (1 - 现金替代折价比例)。

如果上海证券交易所调整上述替代金额计算公式，以上海证券交易所通知规定的为准。

②替代金额的处理程序

对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

对退补现金替代而言，赎回时扣除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该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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折价比例，并据此支付替代金额。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，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，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

其中，调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。

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部分证券，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部分证券。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（本部分简称为 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。先后顺序按照上海证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海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深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资人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人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与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，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（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。

2) 港股通标的股票

本部分“T+1 日”指 T 日起第 1 个开放日。

①替代金额：对于退补现金替代的港股通标的的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × 最新估值汇率 × (1 + 现金替代溢价比例)

对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替

代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价（使用估值汇率调整）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购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

其中，调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。

如果上海证券交易所调整上述替代金额计算公式，以上海证券交易所通知规定的为准。

②替代金额的处理程序

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部分证券，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部分证券。

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。先后顺序按照上海证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在港股通交易期间，根据收到的上海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香港联合交易所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资人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，折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率）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人确定基金应支付赎回投资者的赎回现金替代，即按照赎回时间顺序，依次按照实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用，折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率）的差额，确定基金应支付赎回投资者的赎回现金替代。

T 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，折算为人民币，折算汇率采用当天的估值

汇率)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,折算为人民币,折算汇率采用当天的估值汇率)加上按照T日收盘价(折算为人民币,折算汇率采用当天的估值汇率;被替代组合证券当日无交易的,取最近交易日的收盘价)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日后的第2个工作日内,基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人,相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

T日日终,基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际卖出金额(卖出价格扣除交易费用,折算为人民币,折算汇率采用当天的估值汇率)和按照T日收盘价(折算为人民币,折算汇率采用当天的估值汇率;被替代组合证券当日无交易的,取最近交易日的收盘价)计算的未卖出的部分被替代证券价值,确定基金应支付赎回投资者的赎回现金替代。T日后的第2个港股通交收日后的第2个开放日内基金管理人将应支付的赎回现金替代与相关申购赎回代理机构办理交收。

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

未来如港股通的交易、结算规则发生改变,或上海证券交易所、登记机构ETF申购赎回交易结算规则发生改变,或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变,基金管理人可对现金替代处理规则进行调整,并按规定公告。

4、预估现金部分相关内容

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

预估现金部分的计算公式为：

T 日预估现金部分 = $T-1$ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量、该证券调整后 T 日开盘参考价以及最新估值汇率 (如需) 相乘之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和)

其中, 该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份股的调整后开盘参考价确定。另外, 若 T 日为基金分红除息日, 则计算公式中的“ $T-1$ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。若 T 日为基金最小申购赎回单位调整生效日, 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”需根据调整前后最小申购赎回单位按比例计算。如果 $T-1$ 日至 T 日期间有港股通交易日且非申赎开放日, 则基金管理人可对 $T-1$ 日最小申购赎回单位的基金资产净值等进行调整。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 $T+1$ 日的申购赎回清单中公告, 其计算公式为:

T 日现金差额 = T 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量、 T 日收盘价以及最新估值汇率 (如需) 相乘之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和)

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

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

6、申购赎回清单的格式

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：

最新公告日期	
基金名称	浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	浦银安盛基金管理有限公司
一级市场基金代码	XXXX

T-1 日内容信息：

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

T 日内容信息：

预估现金部分（单位：元）	
现金替代比例上限	
申购上限（单位：份）	
赎回上限（单位：份）	
是否需要公布 IOPV	
最小申购、赎回单位（单位：份）	
申购赎回的允许情况	

成份股信息内容：

证券代码	证券简称	证券数量（股）	现金替代标志	现金替代溢价比例（%）	现金替代折价比例（%）	替代金额（人民币元）

说明：此处为示例，以届时实际公布为准。

申购赎回清单的格式可根据上海证券交易所的系统升级相应调整，具体内容以基金管理人届时在网站上公布的实际内容为准。

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接受申购。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 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接受基金申购申请。
- 4、因特殊情况（包括但不限于相关证券/期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市），导致基金管理人无法正常进行投资管理或无法计算当日基金资产净值。
- 5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、基金管理人开市前因异常情况错误编制或未能公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。
- 8、证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。
- 9、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购份额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购份额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购份额超过单个投资人单日或单笔申购份额上限时。
- 10、港股通交易每日额度不足。
- 11、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。
- 12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、6、7、8、10、11、12 项情形之一且基金管理人决

定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

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接受赎回。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 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接受基金赎回申请或延缓支付赎回对价。
- 4、因特殊情况（包括但不限于相关证券/期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市），导致基金管理人无法正常进行投资管理或无法计算当日基金资产净值。
- 5、基金管理人开市前因异常情况错误编制或未能公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。
- 6、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。
- 7、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。
- 8、当日赎回申请达到基金管理人设定的赎回份额上限，包括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等情况。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 8 项情形以外的情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付。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，并依照有关规定在规定媒介公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

- 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十一、其他申购赎回方式

1、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资人集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则，集合申购业务的相关规则在开始执行前根据相关法规规定进行信息披露。

2、联接基金是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，紧密跟踪标的指数，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。如果本基金推出联接基金，在本基金上市之前，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、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等相关事项将根据相关法规规定进行信息披露。

4、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前根据相关法规规定进行信息披露。

5、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，并根据相关法规规定进行信息披露。

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

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

十二、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者，或者是按照相关法律法规或国家有权机关要求的划转主体。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织或者以其他方式处分。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十三、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。被冻结部分份额仍参与收益分配与支付。法律法规或监管部门或登记机构另有规定的除外。

十四、其他业务

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务，并根据相关法规规定进行信息披露。

十五、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根据相关法规规定进行信息披露。

十六、基金清算交收与登记模式的调整与新增

若上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，无须召开基金份额持有人大会审议。

第十一部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、港股通标的股票及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

（一）资产配置策略

本基金以紧密跟踪标的指数，获取指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下，构建指数化的投资组合。

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。

（二）股票投资策略

1、股票组合构建

本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如出现股票停牌、股票流动性较差或其他影响指数复制的因素，使基金管理人无法依指数权重购买成份股时，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

2、股票组合调整

(1) 定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2) 不定期调整

1) 与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将进行相应调整。

2) 申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3) 其它调整

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金通过严格的投资流程和量化风险管理手段，在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值

小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

3、港股通标的股票的投资策略

本基金可以投资港股通标的股票，将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。

(三) 债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

(四) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对股票市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。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。

(五) 资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

(六) 转融通证券出借业务投资策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，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。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金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；

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

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

(5) 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%；

(6) 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%；

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

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

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

(10) 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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券

回购到期后不得展期；

(11) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

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

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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 参与转融通证券出借业务的资产，不得超过基金资产净值的 30%，其中，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券，纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

(13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(3)、(8)、(12)、(14) 项外，因证券市场波动、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。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(12)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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，基金管理人在履行法定程序后，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行法定程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

3、关联交易原则

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。

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，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。

五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证沪港深消费龙头指数收益率。

中证沪港深消费龙头指数从沪港深三地市场上市证券中选取 50 只市值较大、市占率较高、经营状况良好的消费领域龙头公司证券作为指数样本，以反映沪港深市场消费龙头上市公司证券的整体表现。

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

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并实施期间，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。

六、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

- 3、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；
- 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资产的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、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/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、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。

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；

（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和债券，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、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。

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

8、基金参与转融通证券出借业务，按照相关法律法规、行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

9、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。

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

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

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

五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机

制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

六、估值错误的处理

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

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）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，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本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③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，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回份额等)，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 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，基金管理人与基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场、期货交易市场或外汇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、法律法规规定、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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、登记机构及存款银行或第三方估值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，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、除法律法规、中国证监会另有规定外，《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、审计费、公证费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费用及年费；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、基金开户费和银行账户维护费；
- 11、因参与转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 12、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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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% 的年费率计提。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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

3、除管理费、托管费之外的基金费用，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支付；
- 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项纳税主体，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。

第十五部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算；

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

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

4、本基金收益分配方式采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配方案详见届时基金管理人发布的公告。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。此项调整无需召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在规定媒介公告。

四、基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。

基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日

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

截至收益评价日基金份额净值增长率减去标的指数同期增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，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确定收益分配数额。

五、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

六、收益分配方案的确定、公告与实施

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

七、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披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定方式确认。

二、基金的年度审计

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

第十七部分 基金的信息披露

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

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中国证监会规定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。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。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

5、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三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，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）基金份额上市交易公告书

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

（四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易时，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或基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，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/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（五）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、申购赎回代理券商网站或者营业网点公告当日的申购赎回清单。

（六）基金份额申购、赎回对价

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

（七）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并提前将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

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

（八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

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，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年

度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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。

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。

（九）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、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、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 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、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、本基金开始办理申购、赎回；
- 19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、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；
- 21、基金份额停牌、复牌或终止上市交易；
- 22、本基金变更标的指数；
- 23、本基金推出新业务或服务；
- 24、调整最小申购、赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- 25、基金份额的折算及变更登记；
- 26、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或基金合同规定的其他事项。

(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）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。

（十二）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。

（十三）投资股指期货的信息披露

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。

（十四）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年报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）投资非公开发行股票等流通受限证券的信息披露

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

（十六）投资港股通标的股票相关信息

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)等文件中披露港股通标的股票的投资情况。

（十七）基金参与转融通证券出借业务的信息披露

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)等文件中披露基金参与转融通证券出借业务的情况，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。

（十八）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。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等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披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可在遵循相关法律法规要求的前提下，自主提供信息披露服务，按照《信息披露办法》自主披露信息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其住所、基金上市交易的证券交易所，以供社会公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场、期货交易市场或外汇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、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第十八部分 风险揭示

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

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。本基金为股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资人应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或申购赎回代理券商申购和赎回基金，销售机构名单在基金管理人网站公示。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；本基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人与销售机构都不能保证其收益或本金安全。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

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而产生风险，主要包括：

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

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

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。

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。债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

6、购买力风险。基金投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

二、管理风险

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

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

三、操作和技术风险

在基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记机构等。

四、合规性风险

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

五、本基金特有风险

1、指数化投资的风险

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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2、标的指数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。

3、成份股停牌的风险

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

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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

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

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

4、标的指数波动的风险

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

5、基金投资组合回报与标的指数回报偏离或跟踪误差控制未达约定目标的风险

以下因素可能引发上述风险：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使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，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

(3) 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度；

(4) 由于成份股停牌或因标的指数流通市值过小、流动性差等原因使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) 由于指数成份股发生明显负面事件、面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整时，基金管理人将在履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，从而影响基金对标的指数的跟踪程度；

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

(7) 在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，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度；

(8) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别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。

(9) 本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6、投资港股通标的股票的投资风险

(1) 本基金将通过港股通投资于香港市场，在市场进入、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申

购赎回产生直接或间接的影响。

(2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，本基金将会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特有风险：

1) 港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）；

2) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）；

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现证券交易服务公司认定的交易异常情况时，证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

5) 代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

6) 本基金可投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

7、标的指数变更或不符合要求以及指数编制机构退出或停止服务的风险

尽管可能性很小，如出现指数编制机构变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致

标的指数不宜继续作为标的指数的情形、或标的指数不符合要求、或指数编制机构退出或停止服务，本公司在履行适当程序后，进行适当调整并及时公告。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。

8、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。

9、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或其委托的机构计算并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

10、基金退市风险

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

11、投资者申购失败的风险

如果投资人申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请，则投资人的申购申请失败。

当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购份额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购份额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购份额超过单个投资人单日或单笔申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝。

12、基金份额持有人赎回失败的风险

基金份额持有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，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者赎回申请，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。

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

13、基金份额赎回对价的变现风险

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

14、申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，将会使投资者利益受损或影响申购赎回的正常进行。

15、申购赎回清单标识设置风险

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

16、退补现金替代方式的风险

本基金“退补现金替代”方式不同于其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资人带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯联络或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

17、投资于股指期货可能引致的特定风险

(1) 基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金资产可能因为所持有股指期货合约与标的指数价格波动方向不一致而承受基差风险。因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

（2）盯市结算风险

股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定的时间内补足，按规定期货保证金账户将被强制平仓，从而导致超出预期的损失。

（3）交易对手风险

1) 对手方风险

基金管理人运用基金资产投资于股指期货，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝因所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。另外，基金管理人在银行间市场进行交易，也会因为银行间交易对手违约等发生对手方风险。

2) 连带风险

为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

18、投资于资产支持证券可能导致的特定风险

本基金可能投资于资产支持证券。本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，可能造成基金财产损失。此外，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，从而对基金收益造成影响。

19、非公开发行股票等流通受限证券的投资风险

本基金可以投资于非公开发行股票等流通受限证券。基金投资有明确锁定期的非公开发行股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在

申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

20、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

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

21、本基金可参与转融通证券出借业务，面临的的风险包括但不限于：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 其他风险：如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

六、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致不能及时获得赎回对价或组合证券不能迅速、低成本地变现的风险。

1、基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，基金投资于标的指

数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，所投市场和资产方面的整体流动性较高。但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障持有人利益的基础上，防范流动性风险。

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当调整，尽量缩小跟踪误差，获得更接近标的指数的收益率。

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人将暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购、赎回申请或延缓支付赎回对价的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额或不能及时获得赎回对价的风险。

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

七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

八、其他风险

1、在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、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；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

6、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；

7、其他意外导致的风险。

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或《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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存年限不低于法律法规规定的最低年限。

第二十部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、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，自主作出投资决策，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、现金差额及法律法规和《基金合同》所规定的费用，并主动查询交易申请的确认情况，并妥善行使合法权利；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实、准确、完整；

(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、义务

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

(1) 依法募集资金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

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

(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》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；

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

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

(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、赎回的对价，编制申购赎回清单；

- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露，因审计、法律等向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，保存年限不低于法律法规规定的最低年限；
- (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、《基金合同》和《托管协议》规定履行自己的义务，基金托管人违反法律法规、《基金合同》和《托管协议》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) 本基金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，募集期间网下股票认购所冻结的股票应予以解冻；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利、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、《基金合同》和《托管协议》的规定安全保管基金财产；

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户及其他投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》、《托管协议》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，因审计、法律等向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净值信息、基金份额申购、赎回对价；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存年限不低于法律法规规定的最低年限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(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、《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《基金合同》、《托管协议》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》、《托管协议》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。

本基金份额持有人大会不设立日常机构。

未来，若本基金推出本基金的联接基金，则：

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金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，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

金的基金份额持有人大会并参与表决。

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

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

（一）召开事由

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

- （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）终止基金份额的上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

（13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额

持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，履行适当程序后无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) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

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

(4) 增加、取消或调整基金份额类别设置，对基金份额分类办法及规则进行调整；

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

(6) 基金推出新业务或服务；

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

(8) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(9) 调整基金净值信息、申购赎回清单的内容、申购赎回清单的计算和公告的时间或频率；

(10) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、基金份额申请上市交易、申请在其他证券交易所上市、新增场外申购赎回方式、开通跨系统转托管业务或暂停、停止场外申购赎回业务；

(11) 调整基金的收益分配原则和支付方式；

(12) 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) 授权委托书证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式（包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等）、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及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、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书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见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、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，本基金的基金份额持有人

亦可采用网络、电话、短信或其他非书面方式向其授权代表进行授权。具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式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二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规和中国证监会另有规定或《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》、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。

（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异议，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事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的构成

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

(二) 基金可供分配利润

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

(三) 基金收益分配原则

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；

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

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

4、本基金收益分配方式采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配方案详见届时基金管理人发布的公告。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。此项调整无需召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在规定媒介公告。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(五) 收益分配方案的确定、公告与实施

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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、除法律法规、中国证监会另有规定外，《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、审计费、公证费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费用及年费；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、基金开户费和银行账户维护费；
- 11、因参与转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 12、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，经基金管理人与基

金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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%的年费率计提。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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

3、除管理费、托管费之外的基金费用，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支付；

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项纳税主体，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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、港股通标的股票及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金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；

（3）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外

的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(5) 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%；

(6) 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%；

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

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

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

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

(11) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

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

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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 参与转融通证券出借业务的资产，不得超过基金资产净值的 30%，其中，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券，纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

(13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(3)、(8)、(12)、(14) 项外，因证券市场波动、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。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(12)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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，基金管理人在履行法定程序后，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行法定程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

3、关联交易原则

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。

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，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 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。

(二) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易时，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或基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，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/交易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。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或《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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会

指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存年限不低于法律法规

规定的最低年限。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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（上海国际仲裁中心），仲裁地点为上海市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

九、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 基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：浦银安盛基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

法定代表人：谢伟

成立时间：2007 年 8 月 5 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2007]207 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：191,000 万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-23212888

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

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；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业

务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

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

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、港股通标的股票及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。

基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）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的

90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金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；

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

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

(5) 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%；

(6) 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%；

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

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

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

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

(11) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

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

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%;

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的, 应当符合下列要求:

1) 参与转融通证券出借业务的资产, 不得超过基金资产净值的 30%, 其中, 出借期限在 10 个交易日以上的出借证券, 纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%;

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元;

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

(13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(3)、(8)、(12)、(14)项外, 因证券市场波动、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。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(12)项规定的, 基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的, 从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合

基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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，基金管理人在履行法定程序后，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议项下的基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行法定程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

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，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实

性、完整性、全面性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易，如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。基金管理人可以定期（每半年）和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单和交易结算方式进行更新。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进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人有权向相关交易对手追偿，基金托管人应予以必要的协助与配合。基金托管人根据银行间债券市场成交单对本基金银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒基金管理人。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（五）基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。基金管理人应当按照有关法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关相关法规及协议对

基金银行存款业务进行监督与核查，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。

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。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供存款银行名单的，视为基金管理人认可所有银行。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金参与转融通证券出借业务进行监督。

基金管理人运用基金财产参与转融通证券出借业务，应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制，完善业务流程，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人合法权益。基金托管人应当加强对基金参与转融通证券出借业务的监督和复核，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人合法权益。

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

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、本部分的流通受限证券与上文所述的流动性受限资产的范围并不完全一致，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、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，避免基金出现流动性风险。上述规

章制度须经基金管理人董事会批准。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件(如有)：

拟发行数量、发行价格、监管机构的批准证明文件复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

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

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

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

7、相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

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

随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

(十) 基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的合理疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十一) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人。

(十二) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以

供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令或本托管协议另有约定外,基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户。
- 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,确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金托管资金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失,基金托管人对此予以必要的配合与协助,但不承担赔偿责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二) 募集资金和组合证券的验资

- 1、基金募集期间募集的资金应存于专门账户,募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程予以冻结,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，并由登记机构将组合证券过户至本基金的组合证券账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。（三）基金托管资金账户的开立和管理

基金托管人以本基金的名义开设本基金的基金托管资金账户，保管基金财产的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。基金托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管资金账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

（四）定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若因基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，而产生息差（即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

（五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场登记结算机构的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，持有人账户和资金结算

账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

（六）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

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

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

（七）期货结算账户的开立和管理

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

（八）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人协商一致后开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（九）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中

心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

（十）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应尽可能保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限应符合法律法规的规定。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

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

2、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；

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和债券，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）本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

（5）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

（6）估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。

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

（8）基金参与转融通证券出借业务，按照相关法律法规、行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

（9）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。

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

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

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

3、特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(9)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因,或由于证券/期货交易所、登记机构及存款银行或第三方估值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,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。

(三) 基金份额净值错误的处理方式

1、当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值差错时,视为基金份额净值估值错误;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、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时,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本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,与本基金有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金管理人的建议执行,由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失,由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,由此给基金份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金,就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③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,由基

金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回份额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

4、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,基金管理人与基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

(四) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场、期货交易市场或外汇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、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

(七) 基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制,基金托管人复核。

2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后,进行独立的复核。核对不符时,应及时通知基金管理人共同查出原因,进行调整,直至双方数据完全

一致。

3、财务报表的编制与复核时间安排

(1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。基金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。

(2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

(八) 基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保管时间自相关账户销户之日不少于 20 年。基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于法律法规的规定，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上

海国际仲裁中心)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,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律(不含港澳台立法)管辖。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

(一) 托管协议的变更程序

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

(二) 基金托管协议终止出现的情形

- 1、基金合同终止;
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
- 4、发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

(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《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序:

- (1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

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

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

6、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。

7、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。

8、基金财产清算的公告

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

9、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，保存年限不低于法律法规规定的最低年限。

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,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。主要的服务项目如下:

一、资料寄送

1、基金交易对账单

本基金管理人将按照份额持有人的定制情况,提供电子邮件或短信方式对账单。客户可通过浦银安盛基金客户服务热线进行对账单服务定制或更改。

电子邮件对账单经互联网传送,可能因邮件服务器解析等问题无法正常显示原发送内容,也无法完全保证其安全性与及时性。因此浦银安盛基金管理公司不对电子邮件或短信息电子化账单的送达做出承诺和保证,也不对因互联网或通讯等原因造成的信息不完整、泄露等而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

2、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的基金资讯材料,如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告等。

二、电子化服务

1、手机短信服务

本公司将为基金份额持有人提供每周净值、电子月度对账单,基金份额持有人可致电客服热线人工应答预留手机号码要求定制。

2、电子邮件服务

基金份额持有人可以通过本公司客户服务热线按需要定制各类电子邮件服务,如基金份额周净值、电子月度对账单。

三、客户服务中心

1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自助语音服务和查询服务,客户可通过电话收听基金份额净值,自助查询基金账户余额信息、交易确认情况等。同时,呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

2、网上客户服务

浦银安盛网站为基金份额持有人提供查询服务和资讯服务。基金份额持有人在我公司网站“登录”后,即可 7*24 小时查询个人账户资料,包括基金持有情

况、基金交易明细、基金分红实施情况等；此外，还可修改部分个人账户资料，查询热点问题及其解答，查阅投资刊物等。

公司网址：www.py-axa.com

客服信箱：service@py-axa.com

四、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客服热线自动语音留言、客服热线人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

五、服务渠道

- 1、客服电话：400-8828-999 或 (021) 33079999
- 2、客服传真：(021) 23212999
- 3、公司网站：www.py-axa.com
- 4、客服邮箱：service@py-axa.com
- 5、微信公众号：浦银安盛基金、浦银安盛微理财
- 6、客户端：“浦银安盛基金”APP

第二十三部分 其他应披露事项

暂无。

第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，存放在基金管理人、基金托管人等机构的办公场所和营业场所、基金上市交易的证券交易所，供投资者查阅；投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件。但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十五部分 备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

- （一）中国证监会关于准予浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- （二）浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- （三）浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- （四）浦银安盛基金管理有限公司开放式基金业务规则
- （五）关于申请募集浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金之法律意见
- （六）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

浦银安盛基金管理有限公司
二〇二一年十二月二十四日