

华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金  
联接基金  
更新的招募说明书  
(2022 年第 2 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇二二年三月

## 重要提示

华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2010年9月1日《关于核准上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可【2010】1203号）核准。本基金基金合同自2010年11月18日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本基金的标的指数为上证龙头企业指数。

### （1）指数样本空间

上证全指指数样本。

### （2）选样方法

将样本空间内上市公司证券按照过去一年日均总市值、过去一年日均成交额、上年报营业收入、上年报营业利润四项指标在所有中证二级行业内分别进行排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为待选样本在相应二级行业内的综合排名。选择各行业内综合排名前3名的证券作为指数样本。

### （3）指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\sum$ （证券价格 × 调整股本数 × 权重因子）。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间，以使所有样本权重相等。

有关标的指数具体编制方案及成分股信息详见中证指数有限公司网站，网址：

www.csindex.com.cn。

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

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

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它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金为上证龙头ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：（1）在基金的投资方法方面，上证龙头ETF 采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于上证龙头ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。（2）在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖上证龙头ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，实物申赎上证龙头ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金并不保证和上证龙头ETF业绩表现完全一致，与上证龙头ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）投资比例要求。上证龙头ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（2）申购赎回的影响。上证龙头ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

本招募说明书中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。本次招募说明书更新仅涉及基金经理的变更，相关信息更新截止日为2022年3月14日。除特别说明外，本招募说明书其他所载内容截止日为2022年2月22日，有关财务数据截止日为2021年9月30日，净值表现截止日为2021年6月30日。

# 目录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	18
五、相关服务机构 .....	24
六、基金的募集 .....	55
七、基金合同的生效 .....	56
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	57
九、基金的投资 .....	70
十、基金的业绩 .....	80
十一、基金的财产 .....	82
十二、基金资产的估值.....	84
十三、基金的收益与分配.....	90
十四、基金的费用与税收.....	92
十五、基金的会计与审计.....	95
十六、基金的信息披露.....	96
十七、风险揭示 .....	102
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	110
十九、基金合同的内容摘要.....	113
二十、基金托管协议的内容摘要.....	114
二十一、对基金投资人的服务.....	115
二十二、其他应披露事项.....	117

二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	127
二十四、备查文件 .....	128
附件一：基金合同内容摘要.....	129
附件二：托管协议内容摘要.....	146

## 一、绪言

《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）及其他有关规定以及《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本合同、《基金合同》：《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充；

中国：中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）；

法律法规：中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

《基金法》：《中华人民共和国证券投资基金法》；

《销售办法》：《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》；

《运作办法》：《公开募集证券投资基金运作管理办法》；

《信息披露办法》：《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》；

《流动性风险管理规定》：《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》；

《指数基金指引》：《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》；

元：中国法定货币人民币元；

基金或本基金：依据《基金合同》所募集的华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金；

目标ETF：另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（简称ETF），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且，该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。发售时，本基金选择上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金（简称上证龙头ETF）为目标ETF；

招募说明书：《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其定期的更新；

托管协议：基金管理人与基金托管人签订的《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效修订和补充；



发售公告：《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告》；

《业务规则》：《华安基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

中国证监会：中国证券监督管理委员会；

银行监管机构：中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构；

基金管理人：华安基金管理有限公司；

基金托管人：中国工商银行股份有限公司；

基金份额持有人：根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；

基金代销机构：符合《销售办法》和中国证监会规定的条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；

直销机构：华安基金管理有限公司；

销售机构：直销机构及基金代销机构；

基金销售网点：基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点；

注册登记业务：基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

基金注册登记机构：华安基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构；

《基金合同》当事人：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；

个人投资者：符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人；

机构投资者：符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织；

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

投资者：个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称；

基金合同生效日：基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日；

募集期：自基金份额发售之日起不超过3个月的期限；

基金存续期：《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间；

日/天：公历日；

月：公历月；

工作日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

开放日：销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日；

T日：申购、赎回或办理其他基金业务的申请日；

T+n日：自T日起第n个工作日（不包含T日）；

认购：在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为；

发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为；

申购：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为；

赎回：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为；

巨额赎回：在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额的10%时的情形；

基金账户：基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额余额及其变动情况的账户；

交易账户：各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

转托管：投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务；

基金转换：基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规

定的条件，申请将其所持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为；

**定期定额投资计划：**投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；

**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；

**基金资产总值：**基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；

**基金资产净值：**基金资产总值扣除负债后的净资产值；

**基金份额净值：**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值；

**基金资产估值：**计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程；

**基金份额分类：**本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

**A类基金份额：**在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额

**C类基金份额：**在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额

**销售服务费：**指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

**货币市场工具：**现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具；

**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的股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

指定媒体： 中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；

不可抗力： 本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 4、法定代表人：朱学华
- 5、成立日期：1998年6月4日
- 6、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
- 7、联系电话：021-38969999
- 8、联系人：王艳
- 9、客户服务中心电话：4008850099
- 10、网址：www.huaan.com.cn
- 11、组织形式：有限责任公司
- 12、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务

#### （二）注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5亿元人民币
- 2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	43%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	12%
上海上国投资资产管理有限公司	5%

#### （三）主要人员情况

## 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

### (1) 董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

吴从宏先生，大学学历，公共管理硕士学位。历任上海市国有资产监督管理委员会办公室主任科员、信访办副主任、主任等。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、总裁。

马名驹先生，硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司总经理、副董事长，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司副总裁。现任上海锦江国际投资管理有限公司董事长，Radisson Hospitality AB 董事长，上海锦江资本股份有限公司执行董事、首席执行官，上海锦江资产管理有限公司董事长，锦江国际集团财务有限责任公司董事长，上海齐程网络科技有限公司董事长，长江养老保险股份有限公司董事，史带财产保险股份有限公司监事。

陈志刚先生，本科学历。历任上海市黄浦区人民法院书记员、助理审判员；上海国际信托投资公司金融三部项目经理；上投投资管理有限公司总经理助理、副总经理、总经理；上海国际集团资产管理有限公司监事长；上海华东实业有限公司总经理；上海市再担保有限公司总经理；上海国际集团有限公司风险合规部总经理。现任上海上国投资管理有限公司党支部书记、董事长、法定代表人；兼任申联国际投资有限公司董事、上海证券有限责任公司董事、上海谐意资产管理有限公司监事。

郭传平先生，硕士研究生学历。历任国泰君安证券哈尔滨西大直街营业部副总经理（主持工作）、总经理（兼齐齐哈尔营业部总经理）、黑龙江营销总部副总经理（主持工作）、总经理、黑龙江分公司总经理、上海市委市政府联席办督查

专员助理、国泰君安证券公司业务巡视督导委员会委员、国泰君安期货有限公司党委委员、纪委书记、监事长等职务。现任国泰君安证券公司巡察委员会巡察专员、国泰君安投资管理股份有限公司党委书记、董事长。

独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

周军先生，硕士研究生学历。曾先后担任湖北省体改委副处长，中国证监会湖北证监局办公室主任，中国证监会江西证监局副局长，中国证监会人事教育部（党委组织部）副主任、副部长、巡视员，中证资信公司筹备组负责人、中国上市公司协会监事长，中清汇银（北京）投资管理有限公司顾问。

严弘先生，博士研究生学历，教授。历任美国得克萨斯大学奥斯汀分校金融学助理教授、美国南卡罗来纳大学达拉莫尔商学院金融学终身教职、美国证券交易委员会及美国联邦储备局访问学者、长江商学院和香港大学客座教授、亚洲金融学会会刊《金融国际评论》主编。现任上海交通大学上海高级金融学院金融学教授、学术副院长，中国私募证券投资研究中心主任和全球商业领袖学者项目（GES）学术主任。

## （2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局（原上海证管办）机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高

级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

### （3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，22 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生，21 年金融、基金行业从业经验。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

翁启森先生，硕士研究生学历，27 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

杨牧云先生，本科学历、硕士，21 年金融法律监管工作经验。历任上海市人民检察院科员，上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

姚国平先生，硕士研究生学历，17 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，22 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

范伟隽先生，硕士研究生学历，21 年金融、基金行业从业经验。历任毕马威华振会计师事务所项目经理，中国证监会上海监管局主任科员、副处长，富国基金管理有限公司督察长，华安基金管理有限公司总经理助理。现任华安基金管



理有限公司首席信息官。

## 2、本基金基金经理

刘璇子女士，硕士研究生，7年基金行业从业经验。2014年7月应届毕业生加入华安基金，曾任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020年11月起担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2021年1月起，同时担任华安创业板50指数型证券投资基金的基金经理。2021年7月起，同时担任华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年8月起，同时担任华安CES半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021年9月起，同时担任华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021年12月起，同时担任华安深证100交易型开放式指数证券投资基金和华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

历任基金经理：

许之彦先生，自2010年11月18日至2012年12月22日担任本基金基金经理。

徐宜宜先生，自2011年5月26日至2012年12月22日担任本基金基金经理。

牛勇先生，自2010年11月18日至2018年1月15日担任本基金基金经理。

苏卿云先生，自2017年12月25日至2022年3月14日担任本基金的基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

张霄岭先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部高级总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，基金投资部总监，兼任投资研究部联席总监

邹维娜女士，绝对收益投资部高级总监

胡宜斌先生，基金投资部总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 4、业务人员的准备情况：

截至 2021 年 12 月 31 日，公司目前共有员工 416 人（不含子公司），其中 63.2%具有硕士及以上学位，95.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

#### （四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （五）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证

券法》行为的发生；

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

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

(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) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除为基金管理人进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

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

5、基金经理承诺

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

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

(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 除为基金管理人进行基金投资外，不直接或间接进行其他股票交易，也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## （六）基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

#### （1）健全性原则

内部控制包括公司各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

#### （2）有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

#### （3）独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

#### （4）相互制约原则

公司内部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

公司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。

### 2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

（1）董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

（2）监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

（3）督察长：督察长对董事会直接负责。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。

（4）合规与风险管理委员会：合规与风险管理委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其

他风险控制重大事项。

(5) 合规监察稽核部：合规监察稽核部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，对督察长负责。

(6) 各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

### 4、基金管理人内部控制五要素

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、内部监控。

#### (1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来，通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识，致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设，建立了公司内部控制体系。

## （2）风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查，发现风险，将风险进行分类、按重要性排序，找出风险分布点，分析其发生的可能性及对目标的影响程度，评估目前的控制程度和风险高低，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后，确定应进一步采取的对应措施，对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善，并监督各个环节的改进实施。

## （3）控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中，也得到了一贯的实施。主要包括：组织结构控制、操作控制、会计控制。

### ① 组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工，及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成权责分明、严格有效的三道监控防线：

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

### ② 操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

### ③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；会计账务的组织和处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

#### （4）信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司各级管理人员和员工可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

#### （5）内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查。检验其是否符合设计要求，并及时地充实和完善，反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势，确保内控制度的有效性。

### 5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
成立时间：1984 年 1 月 1 日  
法定代表人：陈四清  
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2021 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 214 人，平均年龄 34 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2021 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1288 只。自 2003 年以来，本行连续十八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 80 项最佳托管银行大奖；是获得奖项



最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- 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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12、建立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款项；
- 15、按照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自行召集基金份额持有人大会；
- 16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### （五）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十四次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

#### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务

部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，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，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互

控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。工商银行通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项

业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### (六) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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。

## 五、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

法定代表人：朱学华

成立日期：1998 年 6 月 4 日

客户服务统一咨询电话：40088-50099

传真：021-58406138

公司网站：www.huaan.com.cn

##### (2) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

#### 2、代销机构

##### (1) 中国银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 1 号

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

##### (2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

##### (3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 招商银行股份有限公司

注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(5) 中信银行股份有限公司

注册地址：中国北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：朱鹤新

客服电话：95558

网址：[www.citicbank.com](http://www.citicbank.com)

(6) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：吕家进

客服电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(7) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

客服电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(8) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人：张东宁

客服电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(10) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客服电话：95577

网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)/[www.95577.com.cn](http://www.95577.com.cn)

(11) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客服电话：95594

网址：[www.bosc.cn](http://www.bosc.cn)

(12) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：4008308003

网址：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

(13) 平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：谢永林

客服电话：95511

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(14) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(15) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：李秀仑

客服电话：962999



网址：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

(16) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

客服电话：95527

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

(17) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市城区运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

客服电话：0769-961122

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

(18) 临商银行股份有限公司

注册地址：山东省临沂市兰山区北京路 37 号

法定代表人：钱进

客服电话：96588

网址：[www.lsbchina.com](http://www.lsbchina.com)

(19) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

客服电话：96699

网址：[www.wzbank.cn](http://www.wzbank.cn)

(20) 乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市新华北路 8 号

法定代表人：杨黎

客服电话：96518

网址：[www.uccb.com.cn](http://www.uccb.com.cn)

(21) 烟台银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

客服电话：4008-311-777

网址：[www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

(22) 大连银行股份有限公司

注册地址：辽宁大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

客服电话：4006640099

网址：[www.bankofd1.com](http://www.bankofd1.com)

(23) 哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人：郭志文

客服电话：95537

网址：[www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.com.cn)

(24) 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

法定代表人：金子军

客服电话：96527

网址：[www.czcb.com.cn](http://www.czcb.com.cn)

(25) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：何沛良

客服电话：0769-961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(26) 嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：夏林生

客服电话：0573-96528

网址：[www.bojx.com](http://www.bojx.com)

(27) 广州银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 30 号

法定代表人：黄子励

客服电话：96699

网址：[www.gzcb.com.cn](http://www.gzcb.com.cn)

(28) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常熟市新世纪大道 58 号

法定代表人：宋建明

客服电话：4009962000

网址：[www.csrcbank.com](http://www.csrcbank.com)

(29) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

客服电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(30) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客服电话：96005

网址：[www.jnbank.com.cn](http://www.jnbank.com.cn)

(31) 江苏昆山农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省昆山市前进东路 828 号

法定代表人：张哲清

客服电话：0512-96079

网址：[www.ksrbc.cn](http://www.ksrbc.cn)

(32) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服电话：96067

网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

(33) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：(010) 66045678

网址：[www.4007898899.com](http://www.4007898899.com)

(34) 深圳新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：马勇

客服电话：4001161188

网址：<https://8.jrj.com/>

(35) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

网址：[www.hexun.com](http://www.hexun.com)

(36) 上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客服电话：021-50810673

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

(37) 贵州华阳众惠基金销售有限公司

注册地址：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区 C 栋标准厂房

法定代表人：李陆军

客服电话：400-8391818

网址：<http://www.hyzhjj.com/>

(38) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(39) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006788887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(40) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

法定代表人：其实

客服电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(41) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(42) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：祖国明

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(43) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.e-rich.com.cn

(44) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：易峥

客服电话：4008-773-772

网址：www.ijijin.cn

(45) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座  
13、14 层

法定代表人：路昊

客服电话：952303

网址：<http://www.my1000.cn/>

(46) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客服电话：4008886661

网址：www.myfp.cn

（47）联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

法定代表人：丁可

客服电话：86-755-36991929

网址：www.lczq.com

（48）玄元保险代理有限公司

注册地址：上海市中国(上海)自由贸易试验区锦康路 258 号 10 楼 02 单元

法定代表人：马永谔

客服电话：86-21-60795000

网址：www.100bbx.com

（49）中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号

客服电话：86-10-63631191, 86-10-63631241, 86-10-63633333

网址：www.e-chinalife.com

（50）中信百信银行股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 8 层

客服电话：400-818-0100

网址：www.aibank.com

（51）中邮证券有限责任公司

注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号（陕西邮政信息大厦 9-11 层）

法定代表人：丁奇文

客服电话：400-888-8005

网址：www.cnpsec.com.cn

（52）上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

客服电话：400-803-2733

网址：www.ajwm.com.cn（搭建中，暂未对外开放）

（53）中国农业银行股份有限公司

注册地址：中国北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

网址：www.abchina.com

（54）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

（55）嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼  
二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（56）乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

法定代表人：王兴吉

客服电话：4000888080

网址：www.qiandaojr.com

（57）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

法定代表人：梁蓉

客服电话：400-6262-818

网址：www.5irich.com

（58）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客服电话：4008 588 588

网址：www.pyfund.com.cn

（59）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：戎兵

客服电话：400-6099-200

网址：<http://www.yixinfund.com/>

(60) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

(61) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客服电话：010-82350618

网址：[www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

(62) 众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

法定代表人：李招弟

客服电话：400-876-9988

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(63) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(64) 通华财富(上海)基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

法定代表人：兰奇

客服电话：400-101-9301

网址：[www.tonghuafund.c](http://www.tonghuafund.c)

(65) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层



法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

(66) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(67) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客服电话：4008188866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

(68) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(69) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人：刘惠

客服电话：400-808-1016

网址：<http://www.fundhaiyin.com>

(70) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人：齐剑辉

客服电话：4006236060

网址：[www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

(71) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-124 室

法定代表人：丁东华

客服电话：400-111-0889

网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(72) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

网址：<https://www.wg.com.cn/>

(73) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室

法定代表人：李振

客服电话：400-066-9355

网址：[fund.sina.com.cn/](http://fund.sina.com.cn/)

(74) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

法定代表人：张琪

客服电话：400 803 1188

网址：<http://www.bzfunds.com>

(75) 济安财富(北京)资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

法定代表人：杨健

客服电话：400-075-6663

网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

(76) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客服电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(77) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

客服电话：400-046-6788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(78) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客服电话：400-820-2819

网址：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

(79) 江西正融资产管理有限公司

注册地址：江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会 38 栋 2107 室

法定代表人：陆雯

客服电话：0791-8669-2502

网址：[www.jxzrzg.com.cn](http://www.jxzrzg.com.cn)

(80) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn/](http://www.jiyufund.com.cn/)

(81) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：4000 178 000

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(82) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

网址：[www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

(83) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

(84) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室

法定代表人：齐小贺

客服电话：0755-83999913

网址：www.fujifund.cn

(85) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢  
23层1号4号

法定代表人：陶捷

客服电话：4000279899

网址：<http://www.buyfunds.cn>

(86) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

(87) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

(88) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5  
楼503

法定代表人：温丽燕

客服电话：4000-555-671

网址：<https://www.hgccpb.com/>

(89) 南京途牛金融信息服务有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号

法定代表人：宋时琳

客服电话：4007-999-999

网址：<http://jr.tuniu.com>

(90) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(91) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：彭运年

客服电话：4008909998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(92) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

法定代表人：王苏宁

客服电话：95118

网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

(93) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

客服电话：4008201515

网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(94) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人：赖任军

客服电话：4009500888

网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(95) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com/>

(96) 天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓  
2-2413 室

法定代表人：李修辞

客服电话：010-59013825

网址：<http://07a46813.atobo.com.cn/>

(97) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：李一梅

客服电话：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(98) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11  
层、12 层

法定代表人：王兵

客服电话：95162

网址：[www.cifco.net](http://www.cifco.net)

(99) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(100) 东海期货有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

客服电话：95531

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

(101) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：贺青

客服电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(102) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：95587

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(103) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(104) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 楼

法定代表人：霍达

客服电话：95565

网址：[www.cmschina.com](http://www.cmschina.com)

(105) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(106) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客服电话：0755-23835888

网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

(107) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：95551/4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（108）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（109）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：021-96250500

网址：<http://www.swhysc.com>

（110）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客服电话：95562

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

（111）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579

网址：[www.cjsc.com](http://www.cjsc.com)

（112）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：4008001001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

（113）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号



法定代表人：吴坚

客服电话：4008096096

网址：www.swsc.com.cn

（114）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：袁笑一

客服电话：4008888133

网址：www.wlzq.cn

（115）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

法定代表人：蔡咏

客服电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

（116）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

客服电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

（117）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（118）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：95573

网址：www.sxzq.com

（119）中信证券(山东)股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

网址：[www.sd.citics.com](http://www.sd.citics.com)

（120）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

法定代表人：魏庆华

客服电话：010-66555835

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

（121）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

客服电话：95330

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

（122）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：4008008899

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（123）方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：高利

客服电话：0731-95571

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

（124）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16/17层

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

网址：<http://www.cgws.com>

（125）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(126) 中信证券（华南）股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

客服电话：020-83963933

网址：<http://www.gzs.com.cn>

(127) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(128) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

客服电话：4008918918

网址：[www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(129) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：叶顺德

客服电话：4006989898

网址：<http://www.xsdzq.cn>

(130) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街8号

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(131) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20

法定代表人：刘世安

客服电话：95511-8

网址：<http://stock.pingan.com>

(132) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人：何春梅

客服电话：95563

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(133) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：蔡一兵

客服电话：4008835316

网址：<http://www.cfzq.com>

(134) 东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星（代理）

客服电话：0769-95328

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

(135) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服电话：95377

网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

(136) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：王少华

客服电话：4008188118

网址：<http://www.guodu.com>

(137) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：赵俊

客服电话：95531

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(138) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

客服电话：4006208888

网址：<http://www.bocichina.com>

(139) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

法定代表人：庞介民

客服电话：0471-4960762

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(140) 国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：马跃进

客服电话：4008222111

网址：[www.gszq.com](http://www.gszq.com)

(141) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

客服电话：4008000562

网址：<http://www.swhysc.com>

(142) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(143) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(144) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦  
A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

客服电话：4008866567

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(145) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人：武晓春

客服电话：4008888128

网址：<http://www.tebon.com.cn>

(146) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：刘建武

客服电话：95582

网址：[www.westsecu.com](http://www.westsecu.com)

(147) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(148) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

客服电话：0931-4890619

网址：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

(149) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：010-65051166

网址：<http://www.cicc.com.cn>

(150) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201 室，501 室，502 室，1103 室，1601-1615 室，1701-1716 室

法定代表人：沈继宁

客服电话：95336

网址：<http://www.ctsec.com>

(151) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

法定代表人：俞洋

客服电话：021-32109999

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(152) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 4 层、18-21 层

法定代表人：高涛

客服电话：95532

网址：<http://www.china-invs.cn/>

(153) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

客服电话：4001022011

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

(154) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

法定代表人：陈宏

客服电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

(155) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

法定代表人：张智河

客服电话：95385

网址: [www.grzq.com](http://www.grzq.com)

(156) 联讯证券有限责任公司

注册地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人: 徐刚

客服电话: 0752-95564

网址: <http://www.lxsec.com>

(157) 江海证券有限公司

注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

客服电话: 4006662288

网址: [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(158) 国金证券股份有限公司

注册地址: 成都市东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

客服电话: 4006-600109

网址: [www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(159) 厦门证券有限公司

注册地址: 福建省厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人: 傅毅辉

客服电话: (0592) 5163588

网址: [www.xmzq.com.cn](http://www.xmzq.com.cn)

(160) 英大证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人: 吴骏

客服电话: 0755-26982993

网址: [www.ydsc.com.cn](http://www.ydsc.com.cn)

(161) 华融证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 祝献忠

客服电话: 95390



网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

(162) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

客服电话：95391 / 400-800-5000

网址：[www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

(163) 中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街23甲

法定代表人：马功勋

客服电话：400-6180-315

网址：[www.iztzq.com](http://www.iztzq.com)

(164) 宏信证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

客服电话：4008-366-366

网址：[www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn)

(165) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

法定代表人：李长伟

客服电话：95397

网址：[www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)

(166) 泉州银行股份有限公司

注册地址：泉州市云鹿路3号

法定代表人：傅子能

客服电话：400-889-6312

网址：[www.qzccb.com](http://www.qzccb.com)

(167) 四川天府银行股份有限公司

注册地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段97号26栋

法定代表人：黄毅

客服电话：86-817-8188888

网址：[www.cgnb.cn](http://www.cgnb.cn)

(168) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

法定代表人：陈洪生

客服电话：86-592-3128888, 86-592-8060888, 86-592-3122716

网址：[www.qihuobuliezhe.com](http://www.qihuobuliezhe.com)

(169) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166 转 849

网址：<http://www.huilinbd.com/>

(170) 大河财富基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市高新区湖滨路 109 号瑜赛进丰高新财富中心 26 层  
1 号

法定代表人：赵鹰龙

客服电话：0851-88235678

网址：<http://www.urainf.com/>

(171) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：刘明军

客服电话：95017（拨通后转 1 转 8） |

网址：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

(172) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：许冬亮

客服电话：95055

网址：<https://www.duxiaoman.com/>

(173) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

网址：[www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

(174) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

法定代表人：王军辉

客服电话：4006-802-123

网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

(175) 上海钜派钰茂基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路379号金穗大厦14楼

法定代表人：洪思夷

客服电话：400-021-2428

网址：<https://www.jpinvestment.cn/>

(176) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

网址：<https://www.yibaijin.com>

(177) 洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路195号9号楼701室

法定代表人：李赛

客服电话：400-8189-598

网址：<https://www.hongtaiwealth.com/>

(178) 南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路389号

法定代表人：夏宏建

客服电话：86-25-58519900

网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

基金管理人可以根据情况增加其他销售代理机构，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号二期31-32层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号二期 31—32 层

法定代表人：朱学华

电话：（021）38969999

传真：（021）33627962

联系人：赵良

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358716

联系人：秦悦民

经办律师：秦悦民、王利民

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：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：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：楼茜蓉

经办注册会计师：魏佳亮、楼茜蓉

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会 2010 年 9 月 1 日证监许可【2010】1203 号文批准设立。

本基金自 2010 年 10 月 25 日起向全社会公开募集，截至 2010 年 11 月 16 日募集工作顺利结束。

本基金是上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金，将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数表现，采用开放式运作方式。基金存续期间为不定期。

本基金的发售对象为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、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 1,745,656,607.24 元人民币，认购资金在募集期间产生的银行利息共计 247,336.84 元人民币。募集资金已于 2010 年 11 月 18 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 18,115 户。按照每份基金份额初始发售面值 1.00 元人民币计算，设立募集期间募集的有效份额共计 1,745,656,607.24 份基金份额，利息结转的基金份额为 247,336.84 份基金份额。两项合计共 1,745,903,944.08 份基金份额，已全部计入本基金基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。其中，本公司基金从业人员认购持有的基金份额总额为 449,520.31 份(含募集期利息结转的份额)，占本基金总份额的比例为 0.03%。按照有关法律规定，本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

## 七、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2010 年 11 月 18 日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）日常申购、赎回与转换的场所

#### 1. 直销机构

##### （1）华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

法定代表人：朱学华

成立日期：1998 年 6 月 4 日

客户服务统一咨询电话：40088-50099

传真：021-58406138

公司网站：www.huaan.com.cn

##### （2）华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

传真电话：（021）33626962

联系人：谢伯恩

#### 2. 代销机构

本基金代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“一、基金份额发售机构”的相关描述。

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。基金投资者应当在销售机构基金销售业务的营业场所按销售机构约定的方式办理基金的申购、赎回与转换业务。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并在管理人网站公示。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

### （二）日常申购、赎回与转换的开放日及时间

#### 1. 日常申购、赎回与转换的开放日为证券交易所交易日，开放日的具体业务

办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9:30-11:30，下午 1:00-3:00 时间段。基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回与转换时除外。

投资者办理基金转换业务，转出基金和转入基金均须为开放日。

2. 华安上海投资理财中心、北京投资理财中心和广州投资理财中心可以在 9:00-15:00 接受投资者申购、赎回与转换申请。华安基金电子交易平台可以 7×24 小时接受投资者的申购、赎回与转换申请。但交易日下午 15:00 以后接受的交易申请均顺延至下一个交易日处理。

3. 若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回与转换时间进行调整，但此项调整不应对投资人利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

### （四）日常申购、赎回与转换的程序

#### 1、日常申购、赎回与转换的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回或转换的申请。基金管理人不得在《基金合同》约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在《基金合



同》约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回或转换申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回或转换的申请无效而不予成交。

## 2、申购、赎回与转换申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金管理人或其委托的基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构申购申请、赎回或转换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购、赎回或转换申请。申购、赎回或转换的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## 3、申购、赎回与转换申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

在办理基金转换业务时，基金转换费用由基金份额持有人承担。

## （五）申购、赎回与转换的数额限制

1、每个基金账户首次申购的最低金额为人民币 1 元，每次追加申购的最低金额为人民币 1 元。各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制；

2、基金份额持有人在销售机构赎回或转出时，每次赎回或转出申请不得低于 1 份基金份额；基金账户中基金份额不足 1 份的，应一次性赎回或转出；

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

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；

4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

(六) 申购费用和赎回费用

1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，并分别公布基金份额净值。本基金 A 类基金份额申购费率最高不超过 1.2%，且随申购金额的增加而递减。C 类基金份额不收取申购费。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金 A 类基金份额对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率为每笔 500 元。

其他投资人申购本基金各类基金份额申购费率如下所示：

份额类型	申购金额 M (元) (含申购费)	申购费率
A 类基金份额	M < 100 万	1.2%
	100 万 ≤ M < 500 万	0.5%
	M ≥ 500 万	每笔 1000 元
C 类基金份额	0	

A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，在投资人申购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、对于持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，按持有期递减。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担。对于 A 类基金份额，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额归入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者赎回费总额的 25%归基金财产。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产。具体费率如下：

份额类型	持有时间（天）	赎回费率
A 类基金份额	$Y < 7$ 日	1.5%
	$7 \text{ 日} \leq Y < 1 \text{ 年}$	0.5%
	$1 \text{ 年} \leq Y < 2 \text{ 年}$	0.25%
	$Y \geq 2 \text{ 年}$	0
C 类基金份额	$Y < 7 \text{ 天}$	1.5%
	$Y \geq 7 \text{ 天}$	0

注：一年指 365 天，两年为 730 天，依此类推。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和销售服务费率。

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），在不违背法律法规规定的情况下，基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

#### （七）申购份额、赎回金额与基金转换份额的计算

##### 1、基金申购份额的计算

（1）对于 A 类基金份额，申购金额包括申购费用和净申购金额，申购份额的计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{或，净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定申购费金额}$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额，或，固定申购费金额}$$

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

例四，某投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=100,000/(1+1.2%)=98,814.23 元

申购费用=100,000-98,814.23=1,185.77 元

申购份额=98,814.23/1.015=97,353.92 份

即投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,353.92 份 A 类基金份额。

例五，某投资者一次性投资 5000 万元申购本基金 A 类基金份额，对应单笔申购费为 1000 元，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000,000-1,000=49,999,000 元

申购费用=1,000 元

申购份额=49,999,000/1.015=49,260,098.52 份

即投资者投资 5000 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.015 元，则可得到 49,260,098.52 份 A 类基金份额。

(2) 对于 C 类基金份额，申购份额的具体计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例六，某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.015=98,522.17 份

即投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.015 元，则可得到 98,522.17 份 C 类基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为：

赎回总额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例六，某投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额，持有期三个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 =  $100,000 \times 1.015 = 101,500.00$  元

赎回费用 =  $101,500 \times 0.5\% = 507.50$  元

赎回金额 =  $101,500 - 507.50 = 100,992.50$  元

即投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额，持有期三个月，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

例七，某投资者赎回本基金 10 万份 C 类基金份额，持有期三个月，赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额 =  $100,000 \times 1.015 = 101,500.00$  元

赎回费用 =  $101,500.00 \times 0\% = 0.00$  元

赎回金额 =  $101,500.00 - 0.00 = 101,500.00$  元

即投资者持有本基金 10 万份 C 类基金份额，持有期三个月，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 101,500.00 元。

### 3、基金转换份额的计算

基金转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费。

转出基金赎回费 = 转出份额  $\times$  转出基金 T 日该类基金份额净值  $\times$  转出基金赎回费率

转出金额 = 转出份额  $\times$  转出基金 T 日该类基金份额净值 - 转出基金赎回费

基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计算收取，具体计算公式如下：

基金转换申购补差费 =  $\max[(\text{转入基金的申购费} - \text{转出基金的申购费}), 0]$ ，

即转入基金申购费减去转出基金申购费，如为负数则取 0

转入金额 = 转出金额 - 基金转换申购补差费

转入份额 = 转入金额  $\div$  转入基金 T 日该类基金份额净值

转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

其中：

转入基金的申购费 =  $[\text{转出金额} - \text{转出金额} \div (1 + \text{转入基金的申购费率})]$  或转入基金固定收费金额

转出基金的申购费 =  $[\text{转出金额} - \text{转出金额} \div (1 + \text{转出基金的申购费率})]$  或转出基金固定收费金额

注 1：转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计

入基金资产。

注 2：本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。

#### 4、基金份额净值的计算

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

T 日各类基金份额净值 = T 日该类基金资产净值 / T 日该类基金份额的余额数量  
 本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

#### 5、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

#### 6、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

### (八) 申购、赎回与转换的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购、赎回与转换申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、投资者转换基金成功后，基金注册与过户登记人在 T+1 工作日为投资人办理转出基金权益的扣除以及转入基金的权益登记并同时办理相关注册与过户登记手续，投资者于 T+2 工作日起（含该日）起可以赎回或转出该转入部分的基金份额。

5、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指

定媒体上公告。

(九) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

1、如除非出现如下情形，基金管理人可以暂停或拒绝基金投资者的申购、转换转入申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- (3) 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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (4) 目标 ETF 暂停申购、暂停上市或目标 ETF 停牌；
- (5) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- (6) 所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

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

- (8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- (9) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

2、发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购、转换转入申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（8）项暂停申购、转换转入情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购、转换转入的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(十) 暂停赎回、暂停转换或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、如出现如下情形，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回、转换转出申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资

产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或目标 ETF 停牌；

(5) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(6) 所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

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

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

2、发生上述情形之一且基金管理人拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回、转换转出申请或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

3、暂停基金的赎回或转换转出，基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回或转换转出公告。

在暂停赎回或转换转出的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回或转换转出业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。



## 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在至少一家指定媒体公告。

### (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

### （十三）基金转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

### （十四）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

如果基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构出现技术系统性能限制或出于其它合理原因，可以暂停转托管业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

### （十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### （十六）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按

照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”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的情形；“司法执行”是指司法机关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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

投资者办理因继承或捐赠原因的非交易过户可到转出方的基金份额托管销售机构申请办理。投资者办理因司法执行原因引起的非交易过户须到基金注册登记机构处办理。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

#### （十七）基金的冻结与解冻

基金注册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注册登记机构认可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按照我国法律法规以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

通过投资于目标 ETF，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

本基金以目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象，把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（含存托凭证）、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

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

### （三）投资理念

指数化投资具有低成本、管理透明及分散化程度高等优点，能稳定地获得与标的指数相近的回报。本基金遵循指数化投资理念，以目标 ETF 为主要投资对象，帮助投资者以较低的成本获取与标的指数和目标 ETF 同步的收益。

### （四）标的指数

本基金的标的指数与目标 ETF 的标的指数相同，为上证龙头企业指数。

上证龙头企业指数由中证指数有限公司编制，挑选上海证券市场中市值规模大、营业收入与营业利润在各行业中处于领先地位的公司股票构成样本股。这些企业都是在行业中规模较大、市场占有率居前的重量级企业，其自身发展对全行业有重大影响，往往能引领全行业的发展方向和兴衰，所以被形象地称为“龙头”，大都具有典型的蓝筹特征。

本基金按照基金合同的约定通过适当程序变更目标 ETF 时，标的指数应相应变更。

### （五）投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。

### （六）投资管理

#### 1、投资决策依据

- （1）法律法规和本《基金合同》的有关规定；
- （2）标的指数编制、调整等相关规定；
- （3）对证券市场发展趋势的研究与判断。

#### 2、投资决策体系

本基金管理人实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明确和运作规范。投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，投资协调小组是基金投资的协调机构和中间桥梁，投资协调小组由基金投资部、

研究发展部、固定收益部的负责人及业务骨干组成。基金经理是基金运作的直接管理人。

### 3、投资管理程序

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

(1) 研究支持：金融工程部依托公司整体研究平台，整合外部研究机构的研究成果开展标的指数跟踪，通过对目标 ETF、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析，进行基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。

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

(3) 组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理对目标 ETF 采取实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式来构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：集中交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 绩效评估：金融工程部定期和不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

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

(7) 合规监察：合规与监察稽核部对整个投资管理流程进行实时监控。

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

## （七）投资限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但国务院另有规定或投资目标 ETF 的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但指定的目标 ETF 除外；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）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%；
- （3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- （4）现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- （5）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产

产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(6) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(9) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(10) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除上述第(4)、(7)、(8)项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### (九) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{上证龙头企业指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$

本基金的标的指数为上证龙头企业指数，同时考虑到投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金设定上述业绩比较基准。

若未来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及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指



数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

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

#### （十）风险收益特征

本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

#### （十一）基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### （十二）基金的融资融券

本基金可以根据届时有有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

#### （十三）基金投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复

核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 9 月 30 日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	43,141,520.67	94.45
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,528,920.29	5.54
8	其他各项资产	4,518.62	0.01
9	合计	45,674,959.58	100.00

### 2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	华安上证龙头 ETF	股票型	交易型开放式 (ETF)	华安基金管理有限公司	43,141,520.67	94.72

### 3 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## **9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证投资。

## **10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

## **11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### **11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

## **12 投资组合报告附注**

12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

12.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	754.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	226.52
5	应收申购款	3,537.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,518.62

### 12.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 十、基金的业绩

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

### 1 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较（截至时间 2021 年 6 月 30 日）。

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①-③	②-④
2021年1月1日至 2021年06月30日	1.62%	0.91%	0.78%	0.96%	0.84%	-0.05%
2020年1月1日至 2020年12月31日	17.76%	1.38%	17.83%	1.42%	-0.07%	-0.04%
2019年1月1日至 2019年12月31日	23.54%	1.21%	25.65%	1.25%	-2.11%	-0.04%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-24.84%	1.27%	-25.94%	1.32%	1.10%	-0.05%
2017年1月1日至 2017年12月31日	15.35%	0.55%	15.05%	0.55%	0.30%	0.00%

2016年1月1日至 2016年12月31日	-9.99%	1.39%	-10.51%	1.41%	0.52%	-0.02%
2015年1月1日至 2015年12月31日	19.07%	2.39%	20.81%	2.40%	-1.74%	-0.01%
2014年1月1日至 2014年12月31日	40.76%	1.01%	40.18%	1.01%	0.58%	0.00%
2013年1月1日至 2013年12月31日	-10.08%	1.28%	-12.64%	1.27%	2.56%	0.01%
2012年1月1日至 2012年12月31日	14.30%	1.12%	12.53%	1.12%	1.77%	0.00%
2011年1月1日至 2011年12月31日	-19.31%	1.14%	-19.42%	1.15%	0.11%	-0.01%
自基金成立 (2010年11月18 日)至2010年12 月31日	-2.10%	0.75%	-2.38%	1.17%	0.28%	-0.42%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类有价证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、目标 ETF 投资及其估值调整；
- 10、其他投资及其估值调整；
- 11、其他资产等。

### （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

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册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、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

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。

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。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金所拥有的目标 ETF、股票、债券、权证、银行存款本息、应收款项和其他投资等资产和负债。

### （四）估值程序

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

### （五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等，不包括本基金所投资的目标 ETF），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，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) 本基金投资的目标 ETF 按照估值日目标 ETF 的净值估值，如该日目标 ETF 未公布净值，则按目标 ETF 最近公布的净值估值；

(3) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估

值。

6、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。

7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

#### （六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

各类基金份额净值的计算均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人（“差错责任方”）应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计

算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对因差错遭受损失的有关当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

(6) 如果差错责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法

规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向差错责任方进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

(5) 基金管理人及基金托管人各类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人各类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### (七) 暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、本基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值与暂停公告基金份额净值的情形；

4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

5、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；

6、中国证监会认定的其他情形。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

## 十三、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）基金期末可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金期末可供分配利润的 10%；若《基金合同》生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日及截止该日的基金可供分配利润、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。基金收益分配方案确认后，由基金管理人按照《信息披露办法》在指定媒体公告并报中国证监会备案。



基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

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

#### （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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （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

在通常情况下，本基金投资于目标ETF的部分豁免管理费，其他部分基金资产的基金管理费按前一日该部分基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = \text{MAX} (E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, 0)$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产中非投资目标ETF的部分基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金投资于目标 ETF 的部分豁免托管费，其他部分基金资产的基金托管费按前一日该部分基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = \text{MAX} (E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, 0)$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产中非投资目标 ETF 的部分基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 4、其他与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第八章的相关规定。

本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规和基金合同的原则另行制定并公告。

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整上述费率或收费方式。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率或收费方式实施前在至少一家指定媒体公告。调整后的上述费率还应在最新的招募说明书中列示。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和 C 类基金份额的基金销售服务费率。

### （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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、C 类基金份额的基金销售服务费率、基金销售费率等相关费率。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和 C 类基金份额的基金销售服务费率。调低基金管理费率、基金托管费率和 C 类基金份额的基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体公告。

### （五）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。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格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，应通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 十六、基金的信息披露

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

### (二) 信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

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

### 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体和基金管理人网站上。

### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

### 4、基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

《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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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定风险。中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### 7、临时报告



本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更目标 ETF；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (8) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (9) 基金募集期延长；
- (10) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (11) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (12) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (13) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (14) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (15) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (16) 除投资指定的目标 ETF 以外的重大关联交易事项；
- (17) 基金收益分配事项；
- (18) 管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (19) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值 0.5%；
- (20) 基金改聘会计师事务所；

- (21) 变更基金销售机构；
- (22) 更换基金注册登记机构；
- (23) 本基金开始办理申购、赎回；
- (24) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (25) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (26) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (27) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (28) 本基金推出新业务或服务；
- (29) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；
- (30) 调整基金份额类别的设置；
- (31) 中国证监会规定的其他事项。

#### 8、澄清公告

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

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

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

#### 10、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，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息

披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 十七、风险揭示

### （一）投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于上证龙头 ETF 资产净值、上证龙头企业指数成份股和备选成份股股票资产与债券资产市场价格的波动。影响上证龙头 ETF 资产净值、股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于上证龙头 ETF、债券与上市公司的股票，其收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

##### （3）利率风险

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

##### （4）通货膨胀风险

基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

##### （5）汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致本基金所投资的上市公司业绩及其股票价格。

##### （6）上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果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。虽然本基

金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

#### （7）债券收益率曲线变动的风险

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

#### （8）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### 2、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。

### 3、流动性风险评估及流动性风险管理工具

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节。

#### （2）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1) 基金合同约定：“本基金以目标 ETF、标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象，把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%”，从投资范围上看，基金资产的流动性良好；

2) 从投资限制上看，基金合同约定：“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- 1) 暂停接受赎回申请；
- 2) 延缓支付赎回款项；
- 3) 延期办理；
- 4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

（4）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  
 基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

- 1) 暂停接受赎回申请

具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“（十）暂停赎回、暂停转换或延缓支付赎回款项的情形及处理”的相关内容。

- 2) 延缓支付赎回款项或延期办理

上述具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

- 3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

- 4) 暂停基金估值

当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

- 5) 中国证监会认定的其他措施。

#### 4、本基金特有的风险

本基金是上证龙头 ETF 的联接基金，主要通过投资于上证龙头 ETF、上证龙头企业指数成份股及其备选成份股来跟踪本基金的标的指数，但本基金并不保证和上证龙头 ETF 业绩表现完全一致，尤其以每日而言。

基金在多数情况下将维持较高的基金和股票投资比例，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。

#### 5、跟踪误差风险

尽管基金管理人将采取严格的风险控制措施，控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，但是，因法律法规的限制及其它限制，本基金不能直接或间接投资于部分标的指数成份股票；此外，基金运作过程中会产生一些管理成本、交易成本以及其它费用，本基金的每日收益率将不可避免的相对标的指数产生偏离，造成跟踪误差。

#### 6、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，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。

#### 7、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) 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款项，由此基金管理人可能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基金份额的风险。

#### 8、成份股退市的风险

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

## 9、指数编制机构停止服务的风险

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

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

### （二）管理风险

#### 1、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能符合基金合同的要求，不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

#### 2、新产品创新带来的风险

随着中国证券市场与国际市场的接轨，各种国外的投资工具也逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产保值增值的同时，也会产生一些新的投资风险，例如可转换债券带来的转股风险，利率期货带来的期货投资风险等。同时，基金管理人可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

### （三）合规性风险

指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。



#### （四）操作风险

基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

#### （五）投资科创板风险

投资科创板股票存在的风险包括但不限于：

##### 1. 退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

##### 2、市场风险

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

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

##### 3、流动性风险

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块流动性可能弱于 A 股，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

##### 4、集中度风险

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

##### 5、系统性风险

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

著。

## 6、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

### （六）存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### （七）其他风险

#### 1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本基金也可能由于向投资者分红而面临现金不足的风险。

#### 2、技术风险

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

#### 3、大额赎回风险

本基金是一开放式基金，基金规模将随着投资者对基金份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资者的连续大量赎回而导致基金管理人被迫赎回目标 ETF 以及抛售债券和股票以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不

利影响。

#### 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

#### 5、其他不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

声明：

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售代理机构销售。但是，本基金并不是销售代理机构的存款或负债，也没有经销售代理机构担保或者背书，销售代理机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的情形除外；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止《基金合同》；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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

- （1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费率；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、赎回费率；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，基金管理人应在中国证监会核准后依照《信息披露管理办法》的

有关规定在至少一家指定媒体公告。

## （二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《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及法律法规、监管机构另有规定的除外）、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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算

报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金财产进行分配。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。



## 二十一、对基金投资人的服务

本公司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，适时对服务项目进行调整。主要服务内容如下：

### （一）投资人对账单服务

本公司在每个自然年度结束后 20 个工作日内向定制纸质对账单的基金份额持有人寄送纸质对账单；每月向定制电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。

### （二）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供 7X24 小时的基金净值信息、投资人账户交易情况、基金产品与服务等信息的自助查询。

客户服务中心人工座席在交易日提供人工服务，基金投资人可以通过客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、账户资料修改等专项服务。

### （三）网络在线服务

投资人可以通过本公司网站的“在线客服”在线就基金投资、交易操作中的各种问题进行咨询互动或留言。

### （四）信息定制服务

投资人可以通过拨打本公司客服热线、发送邮件或者直接登录本公司网站定制电子对账单及资讯服务等各类信息服务。

### （五）投诉受理服务

投资人可以通过各销售机构网点柜台、客服热线人工服务、在线客服、客服电子邮箱、纸质信函等多种不同的渠道提出投诉或意见。本公司将在收到投诉之日起 3 个工作日作出处理回复，情况复杂的，可以延长处理期限，但延长期限不得超过 20 日，并及时告知投诉人延长期限及理由。

### （六）网站交易服务

依据相关的招募说明书、基金合同的约定以及《业务规则》的规定，本公司可向个人投资人和机构投资者提供基金电子直销交易服务。具体业务规则详见基金管理人网站说明。

### （七）基金管理人客户服务联系方式

客户服务中心热线：40088-50099（免长途话费）

客户服务传真：（021）33626962

公司网址：www.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

客服地址：上海市四平路 1398 号 同济联合广场 B 座 14 楼

邮政编码：200092

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务中心热线，或通过电子邮件、传真、信件等方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十二、其他应披露事项

1. 近三年基金管理人及其高级管理人员没有受到过中国证监会及工商、财税等有关机关的处罚。

### 2. 本期公告事项

序号	公告事项	信息披露媒介名称	披露日期
1	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年 第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-21
2	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
3	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
4	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
5	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
6	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25

		站	
7	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
8	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-11
9	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
10	华安基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-24
11	华安基金关于旗下基金参加中信证券华南股份有限公司优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-25
12	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
13	关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-16
14	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子	2020-06-29

		披露网站和公司网站	
15	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
16	上证龙头企业交易型开放式指数基金联接基金更新的招募说明书(2020年第1号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30
17	上证龙头企业交易型开放式指数基金联接基金更新的招募说明书摘要(2020年第1号)	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30
18	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30
19	关于旗下部分基金增加南京证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-07-14
20	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年第2季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-07-21
21	关于旗下基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-08
22	华安基金管理有限公司关于总经理	《中国证券报》、中	2020-08-15

	变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	
23	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-22
24	华安基金管理有限公司关于暂停深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-25
25	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-28
26	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-08-31
27	华安基金管理有限公司关于暂停中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-02
28	华安基金管理有限公司关于暂停深圳市锦安基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-04
29	华安基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-08

30	华安基金管理有限公司关于暂停上海有鱼基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-11
31	关于暂停中民财富基金销售(上海)有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-24
32	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
33	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-28
34	关于旗下基金参加嘉兴银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-29
35	关于暂停前海凯恩斯基金销售有限公司旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-09-30
36	关于旗下基金参加中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-09
37	华安基金管理有限公司关于总经理	《中国证券报》、中	2020-10-17

	变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	
38	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-27
39	华安基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-28
40	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-10-31
41	上证龙头企业交易型开放式指数基金联接基金更新的招募说明书 (2020 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-04
42	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-04
43	关于旗下部分基金参加上海证券有限责任公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-12
44	关于旗下部分基金参加中银国际证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-11-12
45	关于旗下基金参加宁波银行费率优	《中国证券报》、中	2020-11-26



	惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	
46	华安基金关于旗下被动型指数基金持有关联方证券的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-09
47	华安基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司等三家销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-15
48	华安基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-18
49	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-18
50	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-19
51	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-19
52	华安基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-19

53	上证龙头企业交易型开放式指数基金联接基金更新的招募说明书 (2020年第3号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-23
54	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-23
55	华安基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-23
56	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
57	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-28
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-12-30
59	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-21
60	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-02-06

61	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-09
62	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-24
63	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-30
64	华安上证龙头企业交易型开放式指数基金联接基金更新的招募说明书 (2021 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
65	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
66	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同 (更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
67	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分基金基金合同的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
68	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-04-21
69	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的	《中国证券报》、中国证监会基金电子	2021-06-07

	公告	披露网站和公司网站	
70	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-07-20
71	华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2021 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-08-30

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件

- 1、中国证监会批准证券投资基金设立的文件
- 2、基金合同
- 3、法律意见书
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、托管协议
- 7、中国证监会要求的其他文件

（二）存放地点：基金管理人的住所。

（三）查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇二二年三月十六日

## 附件一：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。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。

同一类别的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) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会，对本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 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；

- (4) 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；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销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注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在符合有关法律规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (13) 依照法律法规为本基金的利益对被投资公司行使股东权利，为本基金



的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(14) 在法律法规允许的前提下，为本基金的利益依法为本基金进行融资融券；

(15) 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；

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

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(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、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (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、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与本基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其

他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还认购本基金基金份额的投资者；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

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

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、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，保证其托管的本基金基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表本基金签订的与本基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立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款项；

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召

集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的

基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。

(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：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的情形除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (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) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金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、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费率；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

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

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

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

## (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。

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。

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 40 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。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、方式和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (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，由会议召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见提交的截止时间和收取方式。

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯开会等方式。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人约定的非现场方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以召集人约定的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具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；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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

金份额总数。

#### （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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

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

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

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基

金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

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

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）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 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，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，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怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金

托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

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

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### （一）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《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及法律法规、监管机构另有规定的除外）、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。

#### （二）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金财产进行分配。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 基金财产清算的公告

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

#### （六）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议解决方式

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 附件二：托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层

法定代表人：朱学华

成立时间：1998 年 6 月 4 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号

注册资本：1.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金设立，基金业务管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：（021）38969999

传真：（021）58406389

联系人：冯颖

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

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

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据



承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、新股（含存托凭证）、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

①按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

②根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:

a、本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%;

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

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

d、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

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

f、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

g、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;

h、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

i、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算,法律法规或监管部门另有要求的除外;

j、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。

③法规允许的基金投资比例调整期限

除了上述 d、f、g 项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

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

④本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

⑤相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

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

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

①承销证券；

②向他人贷款或提供担保；

③从事可能使基金承担无限责任的投资；

④买卖其他基金份额，但国务院另有规定或投资于目标 ETF 的除外；

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

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

⑦从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

⑧当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

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

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

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

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

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行

交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

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

③基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

①基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

②此处的流通受限证券与上文提到的流动性受限资产并不完全一致，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基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

④基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

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

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

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

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

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

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

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

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

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

## （二）基金管理人对于基金托管人的业务核查

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和证券账户、复核基

金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、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。

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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予以协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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

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

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

### 三、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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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。

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



金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的华安基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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事宜。

### （三）基金的银行账户的开立和管理

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

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

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

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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

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

#### （五）债券托管账户的开立和管理

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

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

#### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

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

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和

基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

#### 四、基金资产净值计算和会计核算

##### （一）基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日该类基金资产净值除以该计算日该类基金份额总份额后的数值。各类基金份额净值的计算均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

##### （二）基金资产估值方法

##### 1、估值对象

基金所拥有的目标 ETF、股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其

他投资等资产及负债。

## 2、估值方法

本基金的估值方法为：

### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等，不包括本基金所投资的目标ETF），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，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本基金投资的目标ETF按照估值日目标ETF的净值估值，如该日目标ETF未公布净值，则按目标ETF最近公布的净值估值；

③交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

④交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

### (2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

②首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，

在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

（3）因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（6）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。

（7）本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

（8）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。

### （三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

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

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原

因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

#### （四）基金账册的建立

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

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。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资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供

基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 五、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

## 六、争议解决方式

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

约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。