

# 国寿安保中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 更新招募说明书

（2023 年第 1 号）

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 【重要提示】

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2015年3月30日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》（证监许可【2015】485号）注册和2015年4月27日《关于国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函【2015】1130号），进行募集。2020年9月10日本基金经中国证监会准予变更注册（证监许可【2020】2181号）。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。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。

本基金的标的指数为中证500指数。

### 1、样本空间

同沪深 300 指数。

### 2、选样方法

按照以下步骤进行中证 500 指数的样本股选择：

- 1) 在样本空间中剔除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300名的股票；
- 2) 将剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票；
- 3) 将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500 名的股票组成中证 500 指数样本股。

投资者可通过以下路径查询指数信息：  
<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000905>

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。同时由于本基金是跟踪中证500指数的交易型开放式指数基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金

投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、股指期货投资风险、国债期货投资风险、参与转融通证券出借业务的风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等风险。本基金被动跟踪标的指数“中证 500 指数”，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，T+1 日起可赎回。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证 500 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

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

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

本次招募说明书所载内容更新截止日为 2023 年 4 月 30 日，有关财务数据截止日为 2023 年 3 月 31 日（财务数据未经审计），净值表现截止日为 2022 年 12 月 31 日。

## 目 录

第一部分	绪言.....	5
第二部分	释义.....	6
第三部分	基金管理人.....	10
第四部分	基金托管人.....	19
第五部分	相关服务机构.....	22
第六部分	基金的募集.....	28
第七部分	基金合同的生效.....	29
第八部分	基金份额折算和变更登记.....	30
第九部分	基金份额的上市交易.....	31
第十部分	基金份额的申购与赎回.....	33
第十一部分	基金的投资.....	43
第十二部分	基金的业绩.....	54
第十三部分	基金的财产.....	55
第十四部分	基金资产估值.....	56
第十五部分	基金的收益分配.....	60
第十六部分	基金的费用与税收.....	62
第十七部分	基金的会计与审计.....	64
第十八部分	基金的信息披露.....	65
第十九部分	风险揭示.....	71
第二十部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	76
第二十一部分	基金合同的内容摘要.....	78
第二十二部分	基金托管协议的内容摘要.....	91
第二十三部分	对基金份额持有人的服务.....	102
第二十四部分	其它应披露事项.....	103
第二十五部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	104
第二十六部分	备查文件.....	105

## 第一部分 绪言

《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）以及《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指国寿安保基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的

修订

- 16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 21、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》所定义机构投资者
- 22、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 23、人民币合格境外机构投资者：指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 24、投资人或投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 25、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 26、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管等业务。
- 27、销售机构：指直销机构、发售代理机构及申购赎回代理券商
- 28、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构
- 29、发售协调人：指基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构
- 30、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司
- 31、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务
- 32、登记机构：指中国证券登记结算有限责任公司
- 33、指定交易：《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的“指定交易”
- 34、上海证券账户：指上海证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或上海证券投资基金账户
- 35、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

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

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

38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

41、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

42、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、《业务细则》：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所发布的其他相关规则 and 规定

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

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

47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件，将基金份额兑换为申购赎回清单所规定的赎回对价的行为

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

49、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

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

51、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证500指数及其未来可能发生的变更

52、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

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

54、现金替代：指申购或赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金

55、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据



最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

56、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

57、元：指人民币元

58、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

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

60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

61、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

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

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

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

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

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

67、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

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

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

70、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

## 第三部分 基金管理人

### 一、概况

#### （一）基金管理人概况

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址：北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼10、11、12层

法定代表人：王军辉

设立日期：2013年10月29日

注册资本：12.88亿元人民币

存续期间：持续经营

客户服务电话：4009-258-258

联系人：耿馨雅

国寿安保基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准设立。公司股东为中国人寿资产管理有限公司，持有股份85.03%；AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（安保资本投资有限公司），持有股份14.97%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

王军辉先生，董事长，博士。现任中国人寿保险（集团）公司首席投资官，中国人寿养老保险股份有限公司党委书记，国寿安保基金管理有限公司董事长。曾任中国人寿资产管理有限公司党委书记、执行董事、总裁，国寿投资控股有限公司党委书记、总裁，嘉实基金管理有限公司总经理助理兼投资部总监、投资决策委员会执行委员等。

刘凡先生，董事，硕士。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、总裁助理，国寿安保基金管理有限公司董事。曾任中国人寿资产管理有限公司投资总监、SMD，中信证券股份有限公司投资银行委员会委员、董事总经理、债务资本市场部行政负责人等。

鄂华先生，董事、总经理，硕士。现任国寿安保基金管理有限公司总经理、董事。曾任中国人寿保险公司资金运用中心投资分析部职员，中国人寿资产管理有限公司基金投资部副总经理，中国人寿资产管理有限公司权益投资部总经理，国寿安保基金管理有限公司副总经理。

叶蕾女士，董事，硕士。现任中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿安保基金管理有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。曾任中华全国工商业联合会国际联络部副处长、澳大利亚安保集团北京代表处首席代表。

杨金观先生，独立董事，硕士。现任中央财经大学会计学院教授，国寿安保基金管理有限公司独立董事，汉王科技股份有限公司独立董事，龙江元盛和牛产业股份有限公司独立董

事，铨格斯曼航空科技集团股份有限公司独立董事。曾任中央财经大学教务处处长、会计学院党总支书记兼副院长。

周黎安先生，独立董事，博士。现任北京大学光华管理学院教授，北京大学经济与管理学部主任，第十四届全国政协委员，国寿安保基金管理有限公司独立董事，智慧互通科技股份有限公司独立董事。曾任北京大学光华管理学院副院长。

罗琦先生，独立董事，博士。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师，《经济评论》副主编，教育部新世纪优秀人才支持计划入选者，国寿安保基金管理有限公司独立董事，湖北天瑞电子股份有限公司独立董事。曾任武汉造船专用设备厂助理经济师，华中科技大学管理学院讲师、博士后，武汉大学经济与管理学院金融系副教授、副系主任，武汉大学资产经营公司独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

万喜乔先生，监事长。曾任中国人民保险(集团)公司干部，中国人寿保险公司资产管理部员工、资金运用中心综合管理部负责人，中国人寿资产管理有限公司办公室文秘处高级经理、办公室主任助理、办公室副主任、监察审计部副总经理(主持工作)，中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、监察部/审计部总经理、监察部总经理、纪委办公室/党委巡察办公室主任、战略发展部总经理。

张彬女士，监事，硕士。曾任毕马威华振会计师事务所审计员、助理经理、经理、高级经理及部门负责人；现任国寿安保基金管理有限公司合规管理部总经理。

马胜强先生，监事，硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司人力资源部助理、业务主办；现任国寿安保基金管理有限公司党委组织部副部长、人力资源部副总经理。

## 3、高级管理人员

王军辉先生，董事长，博士。简历同上。

鄂华先生，总经理，硕士。简历同上。

王东旭先生，副总经理，法学学士，曾任中国人寿保险公司人事部处长，中国人寿保险(集团)公司人力资源部副总经理、党委组织部副部长，中国人寿资产管理有限公司党群工作部/工会工作部主任，中国人寿资产管理有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长，中国人寿资产管理有限公司监事会监事；现任国寿安保基金管理有限公司党委副书记、副总经理。

张琦先生，股票投资总监，硕士。曾任中银基金管理有限公司基金经理、基金经理助理；现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监及基金经理。

王文英女士，总经理助理，硕士。曾任中国人寿保险股份有限公司财务主管，中国人寿资产管理有限公司财务会计经理，国寿安保基金管理有限公司综合管理部副总经理、总经理；现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理、首席信息官、财务负责人。

王福新先生，总经理助理，博士后。曾任中国海洋大学教师、大公国际资信评估有限公

司金融机构部副总经理、中国人民财产保险股份有限公司博士后工作站研究员，中国人寿保险股份有限公司内控合规部高级主管、投资管理部评估分析处经理、人民币投资管理处高级经理、委托投资管理一处资深经理；现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

王大朋先生，总经理助理，硕士MBA。曾任华安基金管理有限公司零售业务总部总经理、上海丰佳集团罗马尼亚EVERFRESH公司总经理、巨田证券有限公司客户部职员。现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

岳海先生，总经理助理，硕士。自2009年以来，曾先后担任中国银行业监督管理委员会主监管员，中国工商银行资产管理部高级经理，交通银行总行资产管理中心资本市场部负责人，西南证券股份有限公司资产管理金融投资部总经理，景顺长城基金管理有限公司总经理助理等职务。2020年7月加入国寿安保基金管理有限公司，2021年3月任公司总经理助理。

韩占锋先生，督察长，硕士。曾任博时基金管理有限公司担任境内基金资产核算组主管，国寿安保基金管理有限公司运营总监、运营管理部总经理。现任国寿安保基金管理有限公司督察长，国寿财富管理有限公司董事。

#### 4、本基金基金经理

李康先生，基金经理，博士研究生。曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2015年3月起任国寿安保沪深300指数型证券投资基金(2018年8月13日转型为国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金)基金经理。2015年5月至2022年4月任国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。2018年1月起任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2018年1月至2021年5月任国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金(20190401转型为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金)基金经理。2020年3月至2022年4月任国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020年3月起担任国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年8月起担任国寿安保稳丰6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2021年2月起任国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022年2月起任国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022年11月起任国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

鄂华先生：国寿安保基金管理有限公司总经理。

张琦先生：国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监。

段辰菊女士：国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

黄力先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

桑迎先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

黄晓艳女士：国寿安保基金管理有限公司投资经理。

王录琦先生：国寿安保基金管理有限公司投资经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，编制申购赎回清单；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

管人：

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

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

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

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

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定和基金合同约定的其他义务。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资；

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

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规或中国证监会规定禁止的和基金合同约定的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
  - (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
  - (7) 违法现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
  - (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
  - (9) 贬损同行，以抬高自己；
  - (10) 以不正当手段谋求业务发展；
  - (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
  - (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
  - (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。
- 4、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

(五) 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、受雇人或任何第三者牟取利益；
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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，泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不以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、公司内部控制原则

(1) 健全性原则

内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则

通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的操作分离。

(4) 相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置权责分明、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、公司制定内部控制制度原则

（1）合法合规性原则：公司内控制度符合国家法律法规、规章和各项规定。

（2）全面性原则：内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

（3）审慎性原则：制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

（4）适时性原则：内部控制制度的制定随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

### 3、公司内部控制制度主要内容

#### （1）控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

公司管理层贯彻内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，确保全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。公司全体职工必须忠于职守勤勉尽责，严格遵守国家法规和公司各项规章制度。

公司完善法人治理结构，充分发挥独立董事和监事职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

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

内部组织结构监控防线。公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线。

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

#### （2）风险评估

风险评估的前提条件是设立目标。只有先确立了目标，管理层才能针对目标确定风险并采取必要的行动来管理风险。设立目标是管理过程中重要的一部分。尽管其并非内部控制要素，但它是内部控制得以实施的先决条件。

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



### （3）控制活动

授权控制。股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行。公司各业务部门、分支机构和公司员工应当在规定授权范围内行使相应的职责。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

与控股股东之间的风险隔离。公司与控股股东之间经营业务和经营场地有效隔离，经营管理人员不得相互兼职。公司与控股股东之间的财务管理严格隔离，保证账簿分设，会计核算独立。公司与控股股东之间的投资运作和信息传递严格隔离，不得提供有关投资、研究等非公开信息和资料，防范不正当关联交易，禁止任何形式的利益输送。

资产分离控制。基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算。

业务隔离控制。基金资产的运作管理与公司自有资金实行独立隔离运作，在人员配置、岗位职责及其内部管理制度、业务规则与流程、有关银行存款账号、证券账号等分开设置，并分开核算。

岗位隔离制度。公司推行内部工作的目标管理和制定规范的岗位责任制，各岗位人员各司其职、严格遵守操作程序和工作标准，限制越权、穿插、代理等行为，以便于各部门明确分工、各岗位相互监督；包括货币、有价证券的保管与账务相分离，重要空白凭证的保管与使用相分离，投资决策与具体交易操作相分离，前台交易与后台结算相分离，损失的确认与核销相分离，风险评定人员与业务办理岗位相分离等。

物理隔离制度。对于不同工作区划分不同的保密级别，基金投资、交易、研究、公司自有资金管理等相关部门，在空间上和制度上适当隔离。强调中央交易室和综合管理部门的一级保密性，实行严格的门禁制度，并相应建立安全保障设施；对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序、保密守则和监督处罚措施。

危机处理机制。公司制订了切实有效的紧急情况处理制度，建立危机处理机制和程序。

### （4）信息与沟通

维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。公司制定管理和业务报告制度。包括定期报告制度和临时报告制度。定期报告按照每日、每周、每月、每季度等不同的时间、频次进行报告。临时报告是指一旦出现报告事由后的及时报告。

### （5）内部监督

公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的合规管理部和监察稽核部，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

### （6）法律法规指引

公司将严格贯彻基金管理相关的法律法规，严格依法经营。

各部门规章制度及对外提交材料在实施或提交前，均需经合规管理部进行合法合规审核。

督察长和合规管理部负责监察各部门对法律法规、公司规章制度、基金合同的执行情况，着重于因违反法律法规等而产生的风险。

合规管理部负责跟踪法律法规的变化和更新，对业务部门的运作提供合规建议和咨询及政策等方面的咨询及指引，提供合规方面的培训。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连

续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号；2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近310名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2022年3月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共722只。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资

比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

#### （1）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

办公地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

客户服务电话：95521

网址：<http://www.gtja.com/>

#### （2）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

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：4008888108

网址：<http://www.csc108.com/>

#### （3）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn/>

#### （4）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 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82943636

客户服务电话：4008888111；95565

网址：<http://www.newone.com.cn/>

（5）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）

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：顾凌

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

（6）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 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：邵海霞

电话：010-66568124

传真：010-66568990

客户服务电话：95551

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

（7）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

客户服务电话：95553、4008888001

网址：<http://www.htsec.com/>

（8）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 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：储晓明

联系人：钱达琛

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

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

（9）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

传真：021-38565783

客户服务电话：4008888123

网址：<http://www.xyzq.com.cn/>

（10）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：<http://www.95579.com/>

（11）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：<http://www.citicssd.com>



（12）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531—81283938

传真：0531—81283900

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

（13）东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州市星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客户服务电话：4008601555

网址：<http://www.dwjq.com.cn>

（14）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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：4008008899

网址：<http://www.cindasc.com>

（15）国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

联系人：陈炽华

电话：0755-82047857

传真：0755-82835785

客户服务电话：95563

网址：<http://www.ghzq.com.cn>

（16）珠海华润银行股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号珠海华润银行大厦

办公地址：珠海市吉大九洲大道东 1346 号珠海华润银行大厦

法定代表人：刘晓勇

联系人：陈思远

电话：（86-756） 812-1199/812-1100

传真：（86-756） 812-1118

客户服务电话：4008800338

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

（17）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

联系人：冯鹏鹏

电话：025-66996699-881523

传真：025-66008800-889221

客户服务电话：95177

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

（18）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楼、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：黄炎勋

联系人：彭洁联

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务电话：95517

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

（19）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

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

室

法定代表人：王献军

联系人：梁丽

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.hysec.com

基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## 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）

注册地址：上海市浦东新区 陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021 - 23238888

传真：021 - 23238800

联系人：周祎

经办注册会计师：张勇、周祎、蔡晓慧

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2015年3月30日《关于准予国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》（证监许可[2015]485号）注册和2015年4月27日《关于国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函[2015]1130号）募集。

本基金募集期从2015年5月11日至2015年5月22日止，共募集665,869,631.00份国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金份额，有效认购户数为1604户。

本基金的基金类型为股票型证券投资基金，运作方式为契约型开放式，存续期限为不定期。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金的基金合同于2015年5月29日生效。2020年9月10日本基金已经中国证监会准予变更注册（证监许可【2020】2181号）。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额折算和变更登记

根据《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本公司确定2015年6月15 日为国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与2015年6月15日中证500 指数收盘值的五千分之一基本一致。2015年6月15日，中证500指数收盘值为11332.89点，经本基金管理人计算并经托管人复核的本基金基金资产净值为698,828,353.08元，折算前基金份额总额为665,869,631.00份，折算前基金份额净值为1.0495元。

根据《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》中的基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为0.46303161，折算后基金份额总额为308,318,687.00份，折算后基金份额净值为2.2666元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，本基金登记机构已于2015年6月16日进行了变更登记。

## 第九部分 基金份额的上市交易

### 一、基金上市

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

- 1、基金募集金额（含募集股票市值）不低于2亿元；
- 2、基金份额持有人不少于1000人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

### 二、基金份额的上市交易

本基金于2015年7月3日起在上海证券交易所上市交易，场内简称：国寿500，扩位证券简称：国寿500ETF，交易代码：510560。

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

基金管理人可按照监管机构及/或上海证券交易所的规定，经与基金托管人协商一致后，增加本基金的分级份额，将本基金变更为份额分级的交易型开放式指数证券投资基金。基金管理人为实施前述变更应事先报监管机关并公告相应的分级安排，但不必召开基金份额持有人大会审议批准。

### 三、终止上市交易

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

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

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

若因上述1、3、4、5项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为非上市的契约型开放式指数基金。

### 四、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司在相关证券交易所开市后根据申购

赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV）并由上海证券交易所交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

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

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。



## 第十部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

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

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金于2015年7月3日起开放日常申购赎回业务。

### 三、申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》的规定及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则 and 规定；如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 四、申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回申请的确认与通知

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者

可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询确认情况。

投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，注册登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，注册登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

登记机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，对申购与赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在规定媒介公告。

### 五、申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购赎回单位为200万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定规定媒介公告。

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

### 六、申购、赎回的对价、费用

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

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

3、投资者在场内申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

4、申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。申购赎回清单的内容与格式见下文“七、申购赎回清单的内容与格式”。

5、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日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 七、申购赎回清单的内容与格式

### 1、申购、赎回清单的内容

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

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

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

1) 现金替代分为4种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

禁止现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

退补现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

### 2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于标的指数中的上交所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。

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

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

### ③ 替代金额的处理程序

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

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

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

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

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

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

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

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

参考基金份额净值为该ETF前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### 3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其调整后T日开盘参考价。

### 4) 退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数中深交所股票。

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

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

#### ③替代金额的处理程序

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

对退补现金替代而言，赎回时扣除现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券调整后T日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

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

基金管理人将自T日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T日未完成的交易，基金管理人在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为N+2日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。

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

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

N+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

N+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至N+2日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

N+2日后第1个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

#### 4、预估现金部分相关内容

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

T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

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

其中，该证券调整后T 日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

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

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

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

#### 6、申购、赎回清单的格式

T日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息：

最新公告日期	XXXX-XX-XX
基金名称	XX 证券投资基金
基金管理公司名称	XX 基金管理有限公司
一级市场基金代码	*****

T-1 日信息内容：

现金差额（单位：元）	XX.XX
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	XX.XX
基金份额净值（单位：元）	X.XXXX

T 日信息内容：

预估现金部分（单位：元）	XX.XX
最小申购赎回单位（单位：份）	1,000,000
现金替代比例上限	XX%
是否需要公布 IOPV	是
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回
申购上限	无
赎回上限	无

成份股信息内容：

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额

说明：此表仅为示例。

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

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。
- 7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的



申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。
- 4、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。
- 5、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停赎回情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在规定媒介公告。

#### 十、集合申购与其他服务

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

在条件允许时且对基金份额持有人无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，

安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

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

#### 十一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### 十二、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十三、联接基金的特殊申购

本基金在基金合同生效后、开放日常申购之前，将向本基金联接基金开通特殊申购，特殊申购仅开通一日，联接基金以股票或现金特殊申购本基金份额，申购价格以特殊申购日的基金份额净值（保留到小数点后 9 位）为基准计算，不收取申购费。特殊申购份额按照截位的方法保留到整数位，整数位之后的部分舍弃，舍弃部分归入本基金财产。

#### 十四、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 第十一部分 基金的投资

### 一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

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

### 三、投资策略

#### （一）组合复制策略

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不得超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （二）衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生品。

#### 1、股指期货投资策略

本基金股指期货投资，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

## 2、国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与国债期货投资。

本基金可投资其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具等。

### （三）债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

### （四）可转换债券投资策略

本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转债）等含权债券品种，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类含权债券的债券价值和权益价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；权益价值方面仔细开展对含权债券所对应个股的价值分析，包括估值水平、盈利能力及未来盈利预期，此外还需结合对含权条款的研究综合判断内含期权的价值。本基金力争在市场低估该类债券价值时买入并持有，以期在未来获取超额收益。

### （五）证券公司短期公司债券投资策略

基于控制风险需求，本基金将综合研究及跟踪证券公司短期公司债券的信用风险、流动性风险等方面的因素，适当投资证券公司短期公司债券。在期限匹配的前提下，选择风险与收益匹配的品种优化配置。

### （六）资产支持证券投资策略

本基金在参与资产支持证券投资时，将深入分析包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值，同时严格控制信用风险暴露程度，通过信用研究和流动性管理，以期获得长期稳定收益。

### （七）转融通证券出借业务

本基金基于策略性投资的需要，将依据谨慎原则参与转融通证券出借业务，提高基金资产投资收益。本基金作为被动投资的指数型基金，坚持以降低跟踪误差为首要投资目标，在此基础上通过转融通证券出借业务，力争取得稳定的增强收益。基金管理人将逐日监控出借证券对基金资产流动性和指数跟踪偏离的影响，合理确定出借证券的范围，控制出借证券在基金资产中的占比、证券出借平均剩余期限，并及时优化证券出借方案。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### 四、投资管理流程

##### （1）投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数相关规定是基金管理人运用基金财产的投资决策依据。

以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则。

##### （2）投资管理体制

基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作，基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

##### （3）投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节相互协调与有机配合共同构成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：基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成分股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本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研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时召开投资决策委员会会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策；

3) 组合构建：基金经理根据标的指数和研究报告，构建组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险；

4) 交易执行：基金管理人的交易管理部负责本基金的具体交易执行，交易管理部同时履行一线监控的职责；

5) 投资绩效评估：本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并分析基金组合误差的来源等。基金经理据此对投资策略进行总结，根据需要对投资组合进行相应调整；

6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在招募说明书更新时予以公告。

## 五、投资组合管理

### 1、投资组合的构建

基金管理人构建基金投资组合的过程主要分为三个步骤：确定目标组合、制定建仓策略，以及逐步调整组合。

（1）确定目标组合。基金管理人主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合。

（2）制定建仓策略。基金经理依据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素所做的分析，制定合理的建仓策略。

（3）逐步调整组合。基金经理在规定时间内，采取适当的手段和措施，对实际投资组合进行动态调整，直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。本基金将在基金合同生效之日起3个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。

### 2、投资组合的日常管理

本基金投资组合的日常管理内容主要包括以下几个方面：

（1）标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析。跟踪分析标的指数成份股公司行为等信息，如股本变化、分红、停牌、复牌，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而分析是否需要调整投资组合，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析。跟踪分析标的指数的调整等变化，确定标的指数的变化是否与预期相一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析。跟踪分析每日基金申购赎回信息，分析这些信息对投资组合的影响。

（4）投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析。基金经理跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因，并对拟调整的成份股的流动性进行分析。

（5）投资组合调整。使用数量化投资分析模型，寻找出将实际投资组合调整为所追求的目标组合的最优方案，确定组合交易计划；如标的指数成份股调整、成份股公司发生兼并、收购和重组等重大事件，由基金经理召集会议，决定基金的操作策略；进一步调整投资组合，达到所追求的目标组合的持仓结构。

（6）基金每日申购赎回清单的制作。基金经理以T-1日标的指数成份股的构成及其权重为基础，并考虑T日将发生的上市公司变动等情况，制作T日基金申购赎回清单并予以公告。

### 3、投资组合的定期管理

本基金投资组合的定期管理内容主要包括以下几个方面：

（1）每月

每月末，根据基金合同中关于基金管理费和基金托管费等的支付要求，及时检查组合中的现金比例，进行现金支付的准备。

每月末，基金经理对投资策略、投资组合表现及跟踪误差等进行分析，分析最近组合与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差情况，寻找出未能有效控制较大偏离的原因。

（2）每半年

根据标的指数的编制规则与指数调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在标的指数成份股调整生效前，分析并制定投资组合调整策略，尽量减少因成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

4、投资绩效评估

本基金的投资绩效评估内容包括以下几个方面：

每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

本基金管理人定期对基金的运行情况进行量化评估。

基金经理定期根据绩效评估报告分析当月的投资操作、投资组合状况及跟踪误差等情况，重点分析基金的跟踪偏离度和跟踪误差产生的原因、现金管理情况、标的指数成份股调整前后的操作，以及成份股未来可能发生的变动等。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，有权决定是否采用抽样复制的策略且无需召开持有人大会。对于复制方法的变更，本基金管理人需在方法变更前2日内在规定媒介公告，并阐明变更复制方法的原因。

六、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；
- （2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- （4）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；债券回购的最长期限为1年，到期后不得展期；
- （5）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （6）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该

基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

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

（8）本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

（9）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（10）本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

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

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

（13）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需交纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（14）本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

6）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

7）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

8）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债



期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

9) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

(15) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵守下列规定：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的30%；
- 2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；
- 3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；
- 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(16) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第（7）、（11）、（12）、（15）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经

过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政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，本基金可不受上述规定的限制。

#### 七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证500指数。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日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。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 八、风险收益特征

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### 九、基金的投资组合报告

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

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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2023年3月31日，报告期间为2023年1月1日至2023年3月31日。本报告财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	194,368,766.73	99.24
	其中：股票	194,368,766.73	99.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,003.44	0.03
	其中：债券	49,003.44	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	1,431,530.53	0.73
8	其他资产	12,589.67	0.01
9	合计	195,861,890.37	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### （1）报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,747,266.00	0.89
B	采矿业	8,543,047.66	4.37
C	制造业	115,551,616.97	59.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,954,147.80	3.04
E	建筑业	1,816,084.00	0.93
F	批发和零售业	7,771,973.35	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	4,300,171.46	2.20
H	住宿和餐饮业	441,592.80	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,407,373.59	9.41
J	金融业	16,275,006.54	8.32
K	房地产业	3,732,720.44	1.91
L	租赁和商务服务业	2,514,134.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	2,036,074.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,056,651.52	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	406,257.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	2,773,663.00	1.42
S	综合	1,040,986.60	0.53
	合计	194,368,766.73	99.35

### （2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300418	昆仑万维	26,600	1,244,348.00	0.64
2	002384	东山精密	38,500	1,164,625.00	0.60
3	002340	格林美	144,700	1,080,909.00	0.55
4	688256	寒武纪	5,673	1,054,894.35	0.54
5	688777	中控技术	9,800	1,017,730.00	0.52
6	300012	华测检测	47,300	969,650.00	0.50
7	600157	永泰能源	626,000	964,040.00	0.49
8	300308	中际旭创	15,800	930,620.00	0.48
9	002422	科伦药业	31,900	906,598.00	0.46
10	300724	捷佳伟创	7,900	904,155.00	0.46

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	49,003.44	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,003.44	0.03

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113066	平煤转债	490	49,003.44	0.03

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，昆仑万维科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；平顶山天安煤业股份有限公司、浙江中控技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；平顶山天安煤业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基

金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,589.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,589.67

**(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。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

4、 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

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

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

期间	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
2022/1/1-2022/12/31	-19.02%	1.37%	-20.31%	1.38%	1.29%	-0.01%
2021/1/1-2021/12/31	17.67%	0.96%	15.58%	0.97%	2.09%	-0.01%
2020/1/1-2020/12/31	21.94%	1.61%	20.87%	1.62%	1.07%	-0.01%
2019/1/1-2019/12/31	26.44%	1.46%	26.38%	1.47%	0.06%	-0.01%
2018/1/1-2018/12/31	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
2017/1/1-2017/12/31	1.86%	0.91%	-0.20%	0.94%	2.06%	-0.03%
2016/1/1-2016/12/31	-16.79%	1.87%	-17.78%	1.90%	0.99%	-0.03%
2015/5/29-2015/12/31	-27.71%	3.20%	-22.81%	3.30%	-4.90%	-0.10%
2015/5/29-2022/12/31	-39.30%	1.63%	-40.57%	1.66%	1.27%	-0.03%

## 第十三部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十四部分 基金资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

（3）交易所上市并实行全价交易的可转换债券（含可交换债券）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；交易所上市并实行净价交易的可交换债券按估值日收盘价进行估值，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进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）发行时明确在一定期限内限售的股票，包括但不限于非公开发行股票、公开发行



有一定锁定期的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、证券公司短期公司债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

6、本基金参与转融通证券出借业务的，应参照行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

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

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

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

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

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

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

#### 四、估值程序

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、

及时性。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构

进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

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

（八）特殊情况的处理

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

2、由于不可抗力，或证券/期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，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而造成的基金估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十五部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

#### 1、本基金收益分配应遵循下列原则：

- （1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- （2）基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；
- （3）在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配12次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；
- （4）若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；
- （5）基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- （6）基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；
- （7）本基金收益分配采取现金分红；
- （8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 2、基金收益分配数额的确定原则

（1）在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过1%时，基金管理人可以进行收益分配。

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

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

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。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的费用由投资者自行承担。

## 第十六部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 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/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### 3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入

基金费用。

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的指数许可使用基点费

E为前一日的基金资产净值

当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的下限。其中：

$$\text{季度日均基金资产净值} = \text{基金当季存续日的基金资产净值之和} / \text{基金当季存续天数}$$

许可使用基点费的支付方式为每季度支付一次。自基金合同生效日起，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果指数许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法，此项调整无需召开基金份额持有人大会审议。

上述“一、基金费用的种类中第3—11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十七部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

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

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。



## 第十八部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

#### （二）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规定媒介上。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金净值信息

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

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

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

#### （五）基金份额上市交易公告书

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

#### （六）申购赎回清单

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

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载

在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### （八）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政

处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

21、基金推出新业务或服务

22、基金份额折算；

23、本基金发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

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

#### （九）澄清公告

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

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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。

#### （十一）

##### 资产支持证券的投资情况

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

（十二）证券公司短期公司债的投资情况

基金管理人应当在临时公告和定期报告中及时披露投资短期债券的情况。

（十三）股指期货、国债期货的投资情况

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

（十四）参与转融通证券出借业务的情况

本基金参与转融通证券出借业务的，基金管理人应当在基金定期报告等文件中披露基金参与出借业务的情况，并就报告期内发生重大关联交易事项做详细说明。

（十五）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信

息置于各自住所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十九部分 风险揭示

本基金依靠投资获得收益，基金投资人仍有可能承担一定的风险。基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。具体的风险及相应管理措施包括：

### 一、市场风险

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

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

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

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### 二、管理风险

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

### 三、本基金特有的风险

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 2、标的指数波动的风险

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

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

（2）由于标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发

生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

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

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

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

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

#### 4、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 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%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。

#### 5、指数编制机构停止服务的风险

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

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，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。

#### 6、标的指数变更的风险

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

#### 7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情



形，即存在价格折溢价的风险。

#### 8、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所发布参考基金份额净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

#### 9、退市风险

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

#### 10、成份股停牌的风险

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

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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

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

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

#### 11、投资人申购失败的风险

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

#### 12、投资人赎回失败的风险

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

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

#### 13、基金份额赎回对价的变现风险

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

#### 14、股指期货投资风险

本基金可以投资股指期货,可能面临基差风险、合约品种差异造成的风险和标的物风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。合约品种差异造成的风险,是指类似的合约品种,在相同因素的影响下,价格变动不同。表现为两种情况:(1)价格变动的方向相反;(2)价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格,在相同因素作用下变动幅度上的差异,也构成了合约品种差异的风险。标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致,导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。

#### 15、国债期货投资风险

本基金可以投资国债期货,可能面临市场风险、基差风险和流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

#### 16、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务,面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。

首先,流动性风险方面,本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因,发生无法及时变现并支付赎回款项的风险;

其次,信用风险方面,转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券、无法及时支付权益补偿及相关费用的风险;

最后,市场风险方面,证券出借后,可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

#### 17、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:

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

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

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

#### 18、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依

赖等可能会产生影响投资人利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能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风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

#### 19、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

#### 20、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

## 第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后2日内在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十一部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法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、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法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）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则；
- （17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，

应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对



所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

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

（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对价的现金部分；

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

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）依法并按照基金合同和招募说明书的规定申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召集或召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购款项和认购股票、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- （10）提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
- （11）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本基金的基金份额持有人和本基金联接基金（即“国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的基金份额持有人组成，上述两类持有人可以委托其合法授权代表参会并表决。本基金的基金份额持有人持有的每一基金份额为一参会份额，每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### （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，但法律法规和中国证监会另有规定的除外：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率（根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外）；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- （11）基金管理人或基金托管人要求召开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）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调低本基金的申购费率、赎回费率或销售服务费率；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（5）在符合法律法规及本基金基金合同规定、并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

（6）在符合法律法规及本基金基金合同规定、并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整本基金份额类别的设置；

（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

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

（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，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- （1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份

额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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%**）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的**50%**，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的**3**个月以后、**6**个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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%**）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的**50%**，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的**3**个月以后、**6**个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人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，并与基金登记机构记录相符；

**3、**在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

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

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

#### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的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（基金合同另有约定的除外）、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面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和代理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书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

##### 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书面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日内报中国证监会者备案。



基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分对基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后2日内在规定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

#### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

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

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

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

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存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任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

《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、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十二部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：国寿安保基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址：北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼10、11、12层

邮政编码：100033

法定代表人：王军辉

成立日期：2013年10月29日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]1308号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12.88亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证

券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

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

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

- 1、本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；
- 2、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- 3、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；债券回购的最长期限为1年，到期后不得展期；

### 4、

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

- 5、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基

金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

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

7、本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

8、基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

9、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

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

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

12、每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需交纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

13、本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

7) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

8) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

9) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

14、本基金参与转融通证券出借业务，需遵守下列规定：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的30%；
- 2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；
- 3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；
- 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

15、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第6、10、11、14项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。

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

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，基金管理人应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基

金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人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。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择存款银行。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工作日内纠正或拒绝结算。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

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

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通

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

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

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

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。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。

6、基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（八）基金管理人应在基金首次投资中期票据前，与基金托管人签署相应的风险控制补充协议，并按照法律法规的规定和补充协议的约定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中期票据的投资管理制度。

（九）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正



期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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。

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

（十一）基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制，完善业务流程，有效防范和控制风险。基金托管人将对基金参与出借业务进行监督和复核。

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

### 三、基金管理人有关基金托管人的业务监督、核查

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

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等有关违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

### 四、基金财产的保管

### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名开立的证券账户下。同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金资金账户的开立和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。
- 2、基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。
- 3、基金托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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

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

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记机构的结算通知或者基金管理人的指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代和现金差额的结算。

#### （七）其他账户的开立和管理

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

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （八）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

## 五、基金资产净值计算与复核

### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

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

人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 八、托管协议的修改与终止

##### （一）托管协议的变更程序

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

##### （二）基金托管协议终止的情形

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

## 第二十三部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、客服电话服务

#### 1、自动语音服务

提供每周7天、每天24小时的自动语音服务，基金份额持有人可通过电话查询最新公告信息、基金份额净值、基金账户余额、历史交易申请与确认等信息。

#### 2、人工电话服务

人工电话服务时间为周一至周五的9：00~17：00（法定节假日除外）。

客户服务电话：4009-258-258

客户服务传真：010-50850777

### 二、在线咨询服务

投资人可登录基金管理人网站（<http://www.gsfunds.com.cn>）通过“在线客服”或通过基金管理人官方微信(国寿安保基金，微信号gsfunds)“在线客服”栏目进行业务咨询或留言。在线客服提供基金产品信息查询、基金业务咨询、服务投诉和建议等服务。

在线咨询时间为周一至周五的9：00~17：00（法定节假日除外）。

### 三、资讯服务

网站资讯查询：基金份额持有人可通过基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：[www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)

电子信箱：[service@gsfunds.com.cn](mailto:service@gsfunds.com.cn)

### 四、客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的客服电话语音留言、人工电话、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉或提出建议。

### 五、资料寄送

基金销售机构将负责向通过其销售网点认购或申购本基金的基金份额持有人寄送相关资料。

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述客户服务电话或其他方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十四部分 其它应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2022 年第 2 号）	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 20 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第二季度报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 7 月 21 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 8 月 31 日
6	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第三季度报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 10 月 26 日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第四季度报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2023 年 1 月 20 日
8	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2023 年 3 月 31 日
9	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2023 年 4 月 22 日

## 第二十五部分 招募说明书的存放及查阅方式

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，投资者可在办公时间查阅；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)）查阅和下载招募说明书。



## 第二十六部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- （一）中国证监会准予国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金变更注册的文件
- （二）《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （五）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （六）关于申请变更注册国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书
- （七）注册登记协议
- （八）中国证监会要求的其他文件

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。

国寿安保基金管理有限公司

2023 年 6 月 2 日