

# 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)

2021 年临时更新

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2018 年 3 月 30 日证监许可【2018】582 号文注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的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。

本基金的标的指数为标普沪港深中国增强价值指数，指数编制方法如下：

标普沪港深中国增强价值指数系列衡量价值得分相对较高的股票的表现。价值得分根据 3 项基本面指标即市净率、市盈率和市销率计算得出。指数成分股在满足成分股权重中规定的限制条件后由价值得分和经流通股调整后的市值计算权重。

指数	选股池
标普沪港深中国增强价值指数	标普直通中国 A 股指数和标普直通香港指数 (仅注册地在中国内地的股票有资格)

有资格成为标普沪港深中国增强价值指数系列成分股的股票必须在调整参照日满足下表列出的额外流动性标准。

指数	额外流动性标准（3 个月的平均日成交额）
标普沪港深中国增强价值指数	人民币 2,000 万元

同时制定了下列自由流通市值标准：

指数	自由流通市值标准
标普沪港深中国增强价值指数	人民币 50 亿元

此外，标普沪港深中国增强价值指数和标普中国 A 股增强价值指数的合资格股票不得是停牌股票（但现有成分股免受此规定影响）或者被上海证券交易所和深圳证券交易所实行特别处理的股票。

标普沪港深中国增强价值指数的合资格股票股价不得低于 1 港元。如果现有成分股股价跌至 1 港元以下，但截至调整参照日的一个月平均股价不低于 1 港元，则该成分股保留在指数内。

成分股筛选：

指数	增强价值指数内成分股数量
标普沪港深中国增强价值指数	以价值得分由高到低计前 100 只股票

缓冲规定：

为尽量降低成分股的变更，对指数内现有成分股应用 20%的缓冲区间，按照下列方法实施：

适用固定股票数目的标普沪港深中国增强价值指数系列。（1）股票根据价值得分从高到低排列，位居目标股票数目前 80%的股票自动成为成分股；（2）其后，位居目标股票数目前 120%的所有现有成分股根据价值得分从高到低的顺序成为成分股；（3）如果此时未达到目标股票数目，就根据价值得分甄选剩余股票。

成分股权重：

在某一特定调整日期，所有有资格成为标普增强价值指数系列成分股的股票进行加权处理，在满足股票、行业和国家的限制条件后，根据它们在合资格股票池中的市值权重和价值得分情况进行加权处理。这通过优化方法计算。每只股票的最大权重为在 5%和市值在合资格股票池中的权重乘以 20 倍的结果中取其较小者，GICS 行业权重最高为 40%；包括多个国家的地区性指数中某一国家的权重最高为 40%。在满足上述限制条件后，使各成分股有上限权重与无上限权重之差的平方值除以无上限权重之商的和最小。每只股票的权重最低为 0.05%。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见标普道琼斯指数公司网站，网址：<https://chinese.spindices.com/indices/strategy/sp-access-china-enterprises-enhanced-value-index-cny>

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、流动性风险、指数化投资的风险、上市交易风险、本基金投资特定品种及参与特定业务的特有风险、管理风险、信用风险、操作或技术风险、合规性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。其中，指数化投资的风险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、标的指数编制和计算的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险等；基金投资特定品种及参与特定业务的特有风险包括投资港股通股票存在的风险、股指期货等金融衍生品投资风险、资产支持的风险、投资存托凭证的风险、参与融资业务的

风险、参与转融通证券出借业务的风险等。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

本基金出于跟踪标的指数的需要，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》及基金产品资料概要等信息披露文件，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，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。

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

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，但不保证投资于本基金一定盈利，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，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本招募说明书根据本基金管理人于 2021 年 3 月 31 日发布的《华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引〉、〈存托凭证发行与交易管理办法（试行）〉修改基金合同部分条款的公告》进行更新，前述修订内容自 2021 年 3 月 31 日起生效；本基金管理人于 2020 年 11 月 13 日发布的《华宝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》进行更新，上述修订内容自 2020 年 11 月 13 日起生效；其他内容截止日为 2020 年 4 月 30 日；有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 3 月 31 日，数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的，以本次更新的招募说明书为准。

# 目 录

一、绪言.....	2
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	8
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集.....	36
七、基金的备案.....	37
八、基金份额的上市交易.....	38
九、基金份额的申购与赎回.....	40
十、基金的投资.....	51
十一、基金的业绩.....	61
十二、基金的财产.....	62
十三、基金资产估值.....	63
十四、基金收益与分配.....	68
十五、基金的费用与税收.....	70
十六、基金的会计与审计.....	73
十七、基金的信息披露.....	74
十八、风险揭示.....	80
十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	90
二十、基金合同的内容摘要.....	92
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	105
二十二、对基金份额持有人的服务.....	118
二十三、其他应披露事项.....	120
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	122
二十五、备查文件.....	123

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集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》”）、其他有关规定及《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会注册。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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）
- 2、基金管理人：指华宝基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）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《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）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《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
- 9、上市交易公告书：指《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、《流动性管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 16、《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

17、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

18、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

21、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

22、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

23、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

24、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

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

26、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

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

28、销售机构：指华宝基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所办理基金销售业务的会员单位。其中，可通过上海证券交易所办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

29、会员单位：指具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

30、场外：指通过上海证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回



31、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

32、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者开放式基金账户和/或上海证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户业务等

33、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金 A 类基金份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类基金份额登记机构为华宝基金管理有限公司

34、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的 A 类基金份额登记在本系统

35、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的 A 类基金份额登记在本系统

36、场外份额：指登记在登记结算系统下的 A 类基金份额和以及登记在基金管理人注册登记系统下的 C 类基金份额

37、场内份额：指登记在证券登记系统下的 A 类基金份额

38、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册、用于记录其持有的、基金管理人所管理的 A 类基金份额余额及其变动情况的账户，C 类基金份额记录在华宝基金管理有限公司开立的基金账户并登记在华宝基金管理有限公司的注册登记系统

39、基金交易账户：指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认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资、交易等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

40、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户，投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户

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

42、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

43、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

44、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

- 45、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 46、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 47、T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 48、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
- 49、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务申请的工作日
- 50、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
- 51、《业务规则》：指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人、基金销售机构的相关业务规则
- 52、认购：指在基金募集期内，投资者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
- 53、申购：指基金合同生效后，投资者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
- 54、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 55、上市交易：指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
- 56、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
- 57、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，包括系统内转托管和跨系统转托管
- 58、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管或在证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行指定关系变更的行为
- 59、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转托管的行为
- 60、定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、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受理基金申购申请的一种投资方式
- 61、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额的10%

62、元：指人民币元

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

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

65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

66、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

67、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

68、标的指数：指标普沪港深中国增强价值指数

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

71、基金份额分类：本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两个类别。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值

72、A 类基金份额：指不从本类别基金资产中计提销售服务费，且收取申购费的基金份额类别

73、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费的基金份额类别

74、销售服务费：指从基金资产中计提的，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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

总经理：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

成立日期：2003年3月7日

注册资本：1.5亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有49%的股份。

#### （二）基金管理人主要人员情况

##### 1、董事会信息

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理，华宝投资有限公司副总经理，中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪工委书记、工会工委主席。现任华宝基金管理有限公司董事长、中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003年5月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。根据华宝基金管理有限公司《关于公司督察长变更公告》，自2019年10月25日起由其代为履行督察长职务。

魏臻先生，董事。曾任麦肯锡（上海）咨询公司分析师，摩根斯坦利亚洲公司分析师，香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务股份有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司执行董事兼总经理，大成食品（亚洲）有限公司执行董事、董事会主席、执行委员会主席。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

## 2、监事会信息

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

黄洪永先生，监事，硕士。曾任宝钢集团规划部、管理创新部综合主管，宝钢工程党委组织部、人力资源部部长，广东钢铁集团规划部副部长，广东宝钢置业副总经理，宝钢集团人事效率总监、领导力发展总监，中国宝武领导力发展总监。现任中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪工委书记。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托有限责任公司研究部副总经理，华宝基金管理有限公司北京分公司总经理兼综合管理部总经理，现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司互金业务总监兼互金策划部总经理。

## 3、总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002年加入华宝基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生，副总经理，硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

#### 4、本基金基金经理

周晶，博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券（美国）和汇丰证券（美国）从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005年至2007年任华宝基金管理有限公司内控审计风险管理部主管。2011年再次加入华宝基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师，现任公司总经理助理、国际业务部总经理、华宝资产管理（香港）有限公司董事。2013年6月至2015年11月任华宝成熟市场动量优选证券投资基金基金经理，2014年9月起任华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金经理，2015年9月至2017年8月任华宝中国互联网股票型证券投资基金基金经理，2016年3月起任华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016年6月起任华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金经理，2017年4月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）基金经理，2018年3月起任华宝港股通恒生香港35指数证券投资基金（LOF）基金经理，2018年10月起任华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金经理，2019年11月起任华宝致远混合型证券投资基金（QDII）基金经理。

#### 5、 权益投决会信息

闫旭女士，投资副总监、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

光磊先生，投资副总监、国内投资部副总经理、华宝医药生物优选混合型证券投资基金基金经理、华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华宝大健康混合型证券投资基金基金经理、华宝消费升级混合型证券投资基金基金经理、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华宝成长策略混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝核心优势灵活

配置混合型证券投资基金基金经理、华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生，投资副总监、国内投资部总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理、华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

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、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额的申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其它职责。

### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

（1）将其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）利用基金财产或者职务之便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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、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、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不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。

#### (五) 基金管理人内部控制制度

### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）等。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2) 识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。



## 2、内部控制制度

### （1）内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行；

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

### （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

### （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### （4）监察稽核及风险管理制度

合规审计部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

合规审计部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

### 3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，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。

### （二）内部控制组织结构

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

### （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

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

### （二）监督流程

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

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### 1) 直销机构

###### （1）直销柜台

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：上海市浦东新区浦电路 370 号宝钢大厦 905 室

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、50499667、50988055

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

###### （2）直销 e 网金

投资者可以通过华宝基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。网上交易网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

#### 2) 其他场外销售机构

##### （1）中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮编：100818

法定代表人：刘连舸

联系电话：95566

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### （2）中国建设银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮编：100033

法定代表人：田国立

联系电话：95533

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（3）中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区西绒线胡同 28 号天安国际办公楼

邮编：100031

法定代表人：洪崎

联系电话：95568

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

（4）深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人：顾敏

客户服务电话：400-999-8800

公司网址：www.webank.com

（5）北京汇成基金销售有限公司

联系电话：400-619-9059

公司网址：<http://www.hcjijin.com/>

（6）上海万得基金销售有限公司

联系电话：400-821-0203

公司网址：www.520fund.com.cn

（7）平安银行股份有限公司

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

（8）珠海盈米基金销售有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

客户服务电话：020-89629099

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

（9）北京百度百盈基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦

联系电话：95055

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

（10）安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1号楼9层

邮编：518026

法定代表人：王连志

客户服务电话：95517

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

（11）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层

邮编：518034

法定代表人：丁益

联系人：梁浩

客户服务电话：400-6666-888

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

（12）长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号

邮编：430015

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务电话：95579

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（13）北京创金启富投资管理有限公司



办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

联系人：宋春

客户服务电话：400-6262-818

公司网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

（14）上海大智慧基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

联系人：裘爱萍

客户服务电话：021-20219931

公司网址：<https://8.gw.com.cn/>

（15）北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：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

传真：010-61840699

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

（16）第一创业证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18F

邮编：518000

法定代表人：刘学民

传真：0755-25838701

客户服务电话：95358

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

（17）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

邮编：130118

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

（18）东海证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

传真：021-50498825

客户服务电话：95531；400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

（19）东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

邮编：215021

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：400-860-1555

传真：0512-62938527

客户服务电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（20）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：周健男

联系电话：95525

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（21）广发证券股份有限公司

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：马梦洁

客户服务电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

（22）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

邮编：100007

联系人：司琪

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

（23）国金证券股份有限公司

办公地址：成都市东城根上街 95 号

邮编：610015

法定代表人：冉云

联系人：杜晶

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

（24）国联证券股份有限公司

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

邮编：214121

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

传真：0510-82830162

客户服务电话：95570

公司网址：<http://www.glsc.com.cn>

（25）国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系人：朱雅崑

联系电话：400-888-6628

传真：021-38670666

客户服务电话：95521

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

（26）国信证券股份有限公司

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

联系电话：95536

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

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

（27）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

客户服务电话：400-700-9665

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

（28）和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

客户服务电话：400-920-0022

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

（29）华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

邮编：200120

法定代表人：刘加海

传真：021-68777822

客户服务电话：400-820-9898

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

(30) 华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市江东中路 288 号

邮编：210019

法定代表人：周易

联系人：胡子豪

传真：021-83387254

客户服务电话：95597

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

(31) 上海华夏财富投资管理有限公司

客户服务电话：400-817-5666

(32) 上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

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

(33) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(34) 开源证券股份有限公司

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：曹欣

客户服务电话：95325

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

（35）北京肯特瑞基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

客户服务电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

（36）上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

客户服务电话：4000-466-788

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

（37）上海陆金所基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

客户服务电话：4008219031

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

（38）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

联系电话：4000-776-123

客户服务电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

（39）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼

客户服务电话：400-821-5399

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

（40）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

法定代表人：何之江

联系人：王超

联系电话：95511-8

传真：0755-82435367

客户服务电话：95511-8

公司网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

（41）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：400-891-8918

传真：021-53686100，021-53686200

客户服务电话：400-891-8918

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

（42）申万宏源西部证券有限公司

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

邮编：830002

法定代表人：李琦

联系人：陈飙

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

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

（43）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

邮编：200031

法定代表人：李梅

联系人：陈飙

传真：021-33388224

客户服务电话：95523

公司网址：www.swhysc.com

（44）南京苏宁基金销售有限公司

客户服务电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（45）太平洋证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座三单元

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

客户服务电话：95397

公司网址：www.tpyzq.com

（46）深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1810

法定代表人：曾革

联系人：杨苗苗

联系电话：400-877-899

客户服务电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

（47）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（48）浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

联系人：张丽琼

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com



(49) 上海挖财基金销售有限公司

客户服务电话: 021-50810673

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

(50) 西南证券股份有限公司

办公地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

邮编: 400023

法定代表人: 廖庆轩

联系人: 周青

传真: 023-63786212

客户服务电话: 4008-096-096

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

(51) 北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

客户服务电话: 010-62675369

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

(52) 信达证券股份有限公司

办公地址: 北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人: 张志刚

联系电话: 400-800-8899

传真: 010-63081344

客户服务电话: 95321

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

(53) 兴业证券股份有限公司

办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人: 杨华辉

联系电话: 95562

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（54）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系电话：400-6099-200

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（55）奕丰金融服务（深圳）有限公司

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（56）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

邮编：100033

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

传真：010-83574807

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

（57）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

邮编：518033

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：95565

传真：0755-82943227

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（58）中航证券有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层

邮编：100102

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

联系电话：400-886-6567

传真：010-59562637

客户服务电话：400-8866-567

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

（59）中国国际金融股份有限公司

办公地址：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：毕明建

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

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

（60）中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

客户服务电话：400-600-0030

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

（61）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：朱琴

联系电话：95538

传真：021-20315125

客户服务电话：95538

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

（62）中国中金财富证券有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层

01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛

联系人：胡芷境

传真：0755-82026539

客户服务电话：95532 或 400-600-8008

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（63）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

客户服务电话：95587

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

（64）中信期货有限公司

办公地址：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

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60838677

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

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

（65）中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

邮编：100026

法定代表人：张佑君

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(66) 中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

邮编：266000

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

联系电话：95548

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：<http://sd.citics.com/>

(67) 中银国际证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

邮编：200120

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：400-620-8888

传真：021-50372474

客户服务电话：400-620-8888

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

(68) 深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

联系电话：400-678-8887

客户服务电话：400-678-8887

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时在基金管理人网站公示。

## 2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

### （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

住所：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：韩炯

联系电话：（86 21） 3135 8666

传真：（86 21） 3135 8600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

法定代表人：毛鞍山

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、印艳萍

## 六、基金的募集

本基金经中国证监会证监许可【2018】582号《关于准予华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）注册的批复》注册，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，募集期从2018年8月27日起，至2018年10月19日止，共募集246,672,793.41份基金份额，有效认购户数为2,975户。



## 七、基金的备案

本基金基金合同于 2018 年 10 月 25 日正式生效。《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之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）上市交易的地点

上海证券交易所。

### （二）上市交易的时间

本基金基金合同生效后，本基金基金份额（二级市场交易代码：501310）具备上市条件，于2018年11月22日起在上海证券交易所上市交易。

### （三）上市交易的条件

基金合同生效后具备下列条件，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、募集金额不少于2亿元人民币；
- 2、基金份额持有人不少于1000人；
- 3、上海证券交易所规定的其他条件。

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前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

### （四）上市交易的规则

本基金上市交易遵循《上海证券交易所交易规则》及《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

### （五）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照上海证券交易所相关规则及有关规定执行。

### （六）上市交易的行情揭示

本基金在上海证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示本基金前一交易日的基金份额净值。

### （七）上市交易的停复牌和终止上市

本基金的停复牌和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所的相关规定执行。

### （八）其他事项

相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

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

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

基金合同生效后，投资者可通过场外、场内两种方式对 A 类基金份额进行申购与赎回，可通过场外方式申购与赎回 C 类基金份额。

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的场外申购与赎回业务。

投资者也可使用上海证券账户，通过上海证券交易所系统办理本基金 A 类基金份额的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位。

具体的基金销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为港股通交易日，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的港股通正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2018 年 11 月 22 日起开始办理日常申购、赎回业务。

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

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、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （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、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；

4、场外赎回遵循“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；

5、场内申购与赎回业务遵循上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购申请即为成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资者账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项的划付相应顺延。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

##### 4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务的确认及办理的时间和程序进行调

整，并提前公告。

#### （五）申购与赎回的数量限制

1、投资者通过其他场外销售机构和直销 e 网金申购本基金 A 类份额和 C 类份额单笔最低金额为 1 元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为 10 万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为每笔 1 元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。场外销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各场外销售机构的业务规定为准。

2、投资者通过场内销售机构申购本基金 A 类份额时，单笔申购申请的最低金额为 1,000 元，且申购申请的金额必须为 1 元的整数倍。

3、其他销售机构的投资者欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

4、投资者可多次申购，除本招募说明书第八部分中“拒绝或暂停申购的情形”另有约定外，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。

5、投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，单笔赎回份额不得低于 1 份。基金份额持有人赎回时或赎回后在某一销售机构的某一交易账户内保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

6、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。具体请参见招募说明书或相关公告。

7、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

8、基金管理人可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、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购与赎回费用

##### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，C 类基金份额在申购时不收取申购费。

本基金 A 类份额采取前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金 A 类份额，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 A 类份额的申购费率表如下，场内申购费率与场外申

购费率相同。

| A 类份额申购金额（元）        | 申购费率          |
|---------------------|---------------|
| 100 万以下             | 1.20%         |
| 大于等于 100 万，小于 200 万 | 0.60%         |
| 200 万（含）以上          | 按笔收取，1000 元/笔 |

A 类份额申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## 2、赎回费用

本基金 A 类份额赎回费率表如下，A 类份额场内赎回费率与场外赎回费率相同。

| 持有基金份额期限         | A 类份额赎回费率 |
|------------------|-----------|
| 小于 7 日           | 1.50%     |
| 大于等于 7 日，小于 6 个月 | 0.50%     |
| 大于等于 6 个月，小于 1 年 | 0.25%     |
| 大于等于 1 年         | 0         |

注：此处一月按 30 日计算，一年按 365 日计算

本基金 C 类份额赎回费率表如下。

| 持有基金份额期限         | C 类份额赎回费率 |
|------------------|-----------|
| 小于 7 日           | 1.50%     |
| 大于等于 7 日，小于 30 日 | 0.50%     |
| 大于等于 30 日        | 0%        |

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于 7 日的 A 类基金份额投资者的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 7 日的 A 类基金份额投资者的赎回费，基金管理人将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、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》的有关规定在指定媒介上公告。

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，定期或不定期地开展基金促销活动。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的各项销售费率。

5、办理场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### （七）申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

##### 1、申购份额的计算方式

本基金的场外、场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

申购费用适用比例费率时：

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

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日的基金份额净值}$$

场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额由场内证券经营机构退还投资者。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：假定某投资者投资100,000元通过场外申购本基金A类份额，对应的申购费率为1.2%，申购当日的A类基金份额净值为1.0861元，该投资者可得到的A类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.0861 = 90,980.78 \text{ 份}$$

即：投资者投资100,000元通过场外申购本基金A类份额，假定申购当日的A类基金份额净值为1.0861元，可得到90,980.78份A类基金份额。

例：假定某投资者投资100,000元通过场内申购A类基金份额，对应的申购费率为1.2%，申购当日的A类基金份额净值为1.0861元，该投资者可得到的A类基金份额为：



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=98,814.23/1.0861=90,980.78 份=90,980 份

退款金额=0.78×1.0861=0.85 元

即：投资者投资 100,000 元通过场内申购 A 类基金份额，假定申购当日的 A 类基金份额净值为 1.0861 元，可得到 90,980 份 A 类基金份额，退款金额为 0.85 元。

例：某投资者投资 6,000 元通过场外申购本基金 C 类份额，不收取申购费，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0601 元，则其可得到的 C 类份额为：

申购费用=0 元

申购份额=6,000/1.0601=5,659.84 份

投资者投资 6,000 元申购本基金 C 类基金份额，假定申购当日的 C 类基金份额净值为 1.0601 元，可得到 5,659.84 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式

本基金赎回采用份额赎回的方式。赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有期限 9 个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1615 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1615=11,615.00 元

赎回费用=11,615×0.25%=29.04 元

赎回金额=11,615-29.04=11,585.96 元

即：某投资者赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有期限 9 个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1615 元，则其可得到的赎回金额为 11,585.96 元。

3、在投资者申购时收取申购费且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。投资者可通过场内、场外两种渠道申购与赎回 A 类基金份额；可通过场外渠

道申购与赎回 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额参与上市交易，C 类基金份额不参与上市交易。

4、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。

#### （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者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运转。

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者的申购申请。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暂停接受基金申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，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影响或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、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金登记结算系统、证券登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

8、港股通交易额度不足。

9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

10、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

11、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、7、8、11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资者的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人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。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内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）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（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）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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，可对其余赎回申请延期办理。

若基金发生巨额赎回，且存在单个赎回申请人当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份

额 20%（“大额赎回申请人”）的情形，基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“普通赎回申请人”）利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请。

若当日本基金流动性可满足普通赎回申请人的全部赎回申请，则对普通赎回申请人的全部赎回申请予以全部确认。在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且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，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。

若当日本基金流动性已不足以满足普通赎回申请人的全部赎回申请，则按普通赎回申请人的单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认赎回份额，而对所有未确认的赎回申请进行延期办理。

对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的场内处理方式

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相应规则进行处理。

### 4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、公告、通过销售机构告知等其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以按照《信息披露办法》的有关规定自行确定在指定媒介上刊登基金暂停公告的次数，并应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的基金份额净值。

#### （十二）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### （十三）基金的非交易过户

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

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。

### （十四）基金份额的登记和转托管

#### 1、基金份额的登记

（1）本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的 A 类基金份额，登记在登记结算系统中基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购、买入或通过跨系统转托管从场外转到场内的 A 类基金份额，登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。场外申购的 C 类基金份额登记在基金管理人注册登记系统的基金账户下。

（2）登记在证券登记系统中的 A 类基金份额，可以直接申请场内赎回或在本基金上市后在上海证券交易所上市交易。

（3）登记在登记结算系统中的 A 类基金份额，可以直接申请场外赎回，也可以办理跨系统转托管转至证券登记系统后，在上海证券交易所上市交易。

#### 2、基金份额的转托管

基金份额持有人可办理已持有同类基金份额在不同销售机构之间的转托管。本基金 A 类基金份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

##### （1）系统内转托管

1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管或在证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行指定关系变更的行为。

2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

3) 募集期内不得办理系统内转托管。

## （2）跨系统转托管

1)跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

2)跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

（3）基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

（4）本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。

## （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另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## （十六）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。

## （十七）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## （十八）基金份额的质押

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务，基金管理人可制定和实施相应的业务规则。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的股票、存托凭证和中国证监会核准发行上市的其他股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金出于跟踪标的指数的需要，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。

### （三）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。

### 1、组合复制策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

### 3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的同时有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变动走势，并利用债券定价技术，进行个券选择。

### 4、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### 5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

### 6、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

### 7、存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭



证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 8、其他金融工具投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，在履行适当程序后制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。

#### （四）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

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

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（9）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%；

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

（11）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；

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

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

（14）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

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

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

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

（15）本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

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

（17）本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，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；

（18）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；

（19）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方开展逆回购交易的，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；

（20）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；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（6）、（11）、（19）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基

金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管机构取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### （五）标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为标普沪港深中国增强价值指数

本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%

标普沪港深中国增强价值指数用于追踪沪港通、深港通范围内按价值指标选出的 100 只 A 股

和港股的表现。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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

#### （六）风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

#### （八）基金投资组合报告

本基金投资组合报告所载数据截至2020年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 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   | 135,417,615.46 | 93.11        |
|    | 其中：股票  | 135,417,615.46 | 93.11        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 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      | 9,537,680.67   | 6.56   |
|   | -                 | -              | -      |
| 8 | 其他资产              | 476,599.39     | 0.33   |
| 9 | 合计                | 145,431,895.52 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 732,745.00    | 0.51         |
| C  | 制造业              | 16,264,675.20 | 11.37        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 15,098,072.00 | 10.55        |
| F  | 批发和零售业           | 6,441,397.00  | 4.50         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 7,880,112.40  | 5.51         |
| K  | 房地产业             | 6,820,133.00  | 4.77         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 272,600.00    | 0.19         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 53,509,734.60 | 37.40        |

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末未持有积极投资的境内股票。

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 基础材料    | 4,513,659.72 | 3.15         |
| 消费者非必需品 | 2,549,510.82 | 1.78         |
| 消费者常用品  | -            | -            |

|      |               |       |
|------|---------------|-------|
| 能源   | 12,741,948.53 | 8.91  |
| 金融   | 39,930,060.56 | 27.91 |
| 医疗保健 | 2,294,363.75  | 1.60  |
| 工业   | 8,880,076.69  | 6.21  |
| 信息技术 | 829,639.60    | 0.58  |
| 电信服务 | 2,117,134.27  | 1.48  |
| 公用事业 | 2,481,796.50  | 1.73  |
| 房地产  | 5,569,690.42  | 3.89  |
| 合计   | 81,907,880.86 | 57.25 |

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

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称     | 数量（股）     | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 00939  | 建设银行     | 1,313,000 | 7,606,022.55 | 5.32         |
| 2  | 601668 | 中国建筑     | 1,409,500 | 7,428,065.00 | 5.19         |
| 3  | 01288  | 农业银行     | 2,576,000 | 7,319,979.63 | 5.12         |
| 4  | 03988  | 中国银行     | 2,654,000 | 7,202,130.61 | 5.03         |
| 5  | 03328  | 交通银行     | 1,595,000 | 6,922,419.63 | 4.84         |
| 6  | 00386  | 中国石油化工股份 | 1,884,000 | 6,575,789.26 | 4.60         |
| 7  | 600104 | 上汽集团     | 288,500   | 5,914,250.00 | 4.13         |
| 8  | 00857  | 中国石油股份   | 2,038,000 | 5,288,422.50 | 3.70         |
| 9  | 601169 | 北京银行     | 1,082,280 | 5,227,412.40 | 3.65         |
| 10 | 00998  | 中信银行     | 1,047,000 | 3,663,946.14 | 2.56         |

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

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

4、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。

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

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

## (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## (1) 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

## (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

## (3) 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

(1) 标普沪港深价值增强指数基金截至 2020 年 3 月 31 日持仓前十名证券中的北京银行(601169)于 2019 年 9 月 3 日和 2019 年 9 月 25 日收到中国银保监会北京监管局罚款处罚，由于公司存在：个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权，个别个人商办用房贷款违反房地产调控政策，同业投资通过信托通道违规发放土地储备贷款；员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改，同业业务专营部门制改革不到位，同业投资违规接受第三方金融机构信用担保。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 6,653.75   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 3,431.81   |
| 4  | 应收利息    | 2,153.46   |
| 5  | 应收申购款   | 464,360.37 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
|   | -     | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 476,599.39 |

(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

1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

2) 报告期末积极投资前五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积极投资的股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。



## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2020 年 3 月 31 日，所列数据未经审计。

本报告期 A 类基金份额净值增长率与同期比较基准收益率比较如下：

| 阶段                    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标准差<br>② | 业绩比较基准收益率<br>③ | 业绩比较基准收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2018/10/25-2018/12/31 | -4.54%     | 0.72%         | -1.64%         | 0.94%             | -2.90% | -0.22% |
| 2019/01/01-2019/12/31 | 5.74%      | 0.94%         | 4.27%          | 0.91%             | 1.47%  | 0.03%  |
| 2020/01/01-2020/03/31 | -13.60%    | 1.93%         | -13.63%        | 1.85%             | 0.03%  | 0.08%  |
| 2018/10/25-2020/03/31 | -12.79%    | 1.14%         | -10.61%        | 1.12%             | -2.18% | 0.02%  |

本报告期 C 类基金份额净值增长率与同期比较基准收益率比较如下

| 阶段                    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标准差<br>② | 业绩比较基准收益率<br>③ | 业绩比较基准收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|-----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 2019/05/17-2019/12/31 | 2.32%      | 0.77%         | 0.36%          | 0.74%             | 1.96%  | 0.03% |
| 2020/01/01-2020/03/31 | -13.69%    | 1.93%         | -13.63%        | 1.85%             | -0.06% | 0.08% |
| 2019/05/17-2020/03/31 | -11.69%    | 1.20%         | -13.32%        | 1.15%             | 1.63%  | 0.05% |

## 十二、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证券及票据价值、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。

### （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。

## 十三、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、股指期货合约、权证、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、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）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，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）在交易所市场上市交易或挂牌转让的债券（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价或按照第三方估值机构提供的价格估值；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

#### 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）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃

市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

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

#### 4、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 5、投资证券衍生品的估值方法

（1）从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值；

（2）首次发行未上市的权证，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）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值；

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

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

7、基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具

体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

#### 10、存托凭证的估值

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。

11、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，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1、某一类别基金份额净值是按照每个估值日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类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。当任一类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

者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### （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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停基金估值；

4、法律法规、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

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值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 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及其登记结算公司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或减轻由此造成的影响。

## 十四、基金收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的 A 类基金份额以及登记在基金管理人注册登记系统下的 C 类基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的 A 类基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投



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。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及基金管理人的相关规定。

## 十五、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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、标的指数使用相关费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券/期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、账户开户费用和账户维护费；
- 11、A类基金份额上市费用和年费；
- 12、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 13、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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 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，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，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 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 4、标的指数使用相关费用

#### （1）标的指数许可使用费

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

若任一年度累计计提指数许可使用费金额按年度最后一日（如为节假日取最近一日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价折算的金额小于指数许可使用协议规定的年度费用下限，则基金于该年度最后一日补提标的指数许可使用费至指数使用许可协议规定的费用收取下限，本基金标的指数许可使用费收取下限为每年 30,000 美元。

#### （2）标的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日计提，每年 5,000 美元。计算方法如下：

$H=5,000 \times \text{中国人民银行公布的人民币兑美元汇率中间价} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的指数数据使用费

标的指数数据使用费每日以人民币计提，按年度支付。若由于汇率影响当年计提的标的指数数据使用费高于或低于 5,000 美元，则基金于该年度最后一日调整计提的数据使用费至 5,000 美元。

经基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费和标的指数数据使用费划付指令，基金托管人于次年首日起 15 日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数许可使用协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数许可使用协议约定的指数许可使用费和指数数据使用费的计算方法、费率和支付方式发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费和指数数据使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告，此项调整无须召开基金份额持有人大会。

上述（一）基金费用的种类”中第 5—13 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。

## 十六、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、期货相关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，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》的有关规定在指定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性管理规定》、《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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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：

- 1、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指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(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，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

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

## 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介上。

## 3、《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指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金份额上市交易公告书

本基金获准在上海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至少3个工作日将基金份额上市交易公告书登载于指定媒介上。

## 5、基金净值信息

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

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后

一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 6、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格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，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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达到或超过基金份额总数 20% 的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在定期报告『影响投资者决策的其他重要信息』项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### 8、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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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，但中国证监会另有规定的除外；
- （14）基金收益分配事项；
- （15）管理费、托管费和销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （16）任一类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延期办理；
- （19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- （20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- （21）本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- （22）本基金增加或变更份额类别设置；
- （23）本基金 A 类基金份额停复牌或终止上市；
- （24）本基金变更标的指数；
- （25）本基金采用摆动定价机制进行估值；
- （26）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响

响的其他事项或中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。

#### 9、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和基金上市交易的证券交易所。

#### 10、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。

#### 11、投资香港联合交易所上市的港股通标的股票相关公告

本基金应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 12、清算报告

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

#### 13、中国证监会规定的其他信息。

若本基金投资股指期货，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交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

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

若本基金参与融资及转融通，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后 2 个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的

比例、锁定期等信息。

#### （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规定。

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择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指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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备于各自住所和基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### （八）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。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、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：

**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。

**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。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

**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。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 2、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人有权接受投资者的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行股票买卖。然而，市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的股票，其流动性都各不相同。一般来说，股市上涨期，市场流动性较高；股市下跌期，市场流动性低；大盘蓝筹股流动性高，小盘垃圾股流动性较低。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出股票，或者必须付出较高成本才能买进或卖出股票，这样，就在两个方面产生了风险：

当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进股票，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出股票，从而影响本基金的投资业绩。

#### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或

应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停、基金采用摆动定价等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险匹配。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的股票、存托凭证和中国证监会核准发行上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。标的资产大部分为股票资产，一般情况下具有较好的流动性。同时，本基金严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。除此之外，本基金管理人将根据历史经验和市场情况动态调整基金中高流动性资产的比例并通过组合管理、分散投资对各类标的资产进行合理配置，以防范流动性风险。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金管理人需要根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以接受所有赎回申请。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，需充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 20%以上的，基金管理人可对其采取延期办理赎回申请的措施。

#### （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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序

并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能对投资者有以下潜在影响：投资者的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资者完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同；投资者接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟；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；投资者没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理、或被暂停接受、或被延缓支付赎回款项等。

### 3、指数化投资的风险

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动，具有对股票市场的系统性风险，不能规避市场下跌的风险和个股风险。

#### （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报率可能存在偏离。

#### （2）标的指数波动的风险

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

#### （3）标的指数编制和计算的风险

本基金的标的指数由指数编制机构负责日常管理。指数编制机构在编制、计算相关指数时没有义务顾及到本基金管理人和投资者的利益。指数编制机构不保证标的指数的准确性和正确性，亦不保证在指数编制和计算时不会损害到本基金投资者和基金管理人的利益。

#### （4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪基准之间的偏离程度，是控制投资组合与基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。以下原因可能会影响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

- 1) 标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- 2) 标的指数成份股的调整；
- 3) 基金现金资产的拖累；
- 4) 基金的管理费、托管费和证券交易费用等带来的跟踪误差；
- 5) 指数成份股停牌、摘牌等因素带来的偏差；
- 6) 由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差。

7) 特殊情况下, 如果本基金采取成份股替代策略, 基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与标的指数收益率产生偏离。

8) 其他因素产生的偏离。如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。

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内, 年化跟踪误差控制在 5% 以内, 但因上述原因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) 标的指数变更的风险

根据基金合同的约定, 如出现变更本基金标的指数的情形, 经履行适当程序, 本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资策略将会改变, 投资组合将随之调整, 本基金的风险收益特征将与新的标的指数保持一致, 投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### (6) 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, 如对基金份额持有人利益有实质性影响, 则在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前, 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。

#### (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) 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, 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。

3) 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。

#### 4、上市交易风险

本基金在上海证券交易所上市交易，由于上市期间可能因各种原因导致停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金，产生风险；同时，可能因上市后流动性不足导致流动性风险。

#### 5、本基金投资特定品种及参与特定业务的特有风险

##### （1）投资港股通股票存在的风险

###### 1) 港股通制度限制带来的风险

###### ①港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

###### ②港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而导致港股不能及时卖出，带来一定的流动性风险，以及基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

###### ③港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通标的股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通标的股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通标的股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通标的股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

（如果未来港股通相关业务规则发生变化，以新的业务规则为准。）

###### 2) 汇率风险

本基金以人民币募集和计价，但本基金通过港股通投资香港证券市场。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

###### 3) 境外市场的风险



基金将通过港股通投资于香港证券市场，可能会受到香港市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。

#### ①香港市场风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动。

#### ②香港交易市场制度或规则不同带来的风险

香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a. 港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，因此每日涨跌幅空间相对较大；

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

#### c. 交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中港股投资比例，造成比例超标的风险。

#### d. 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联合交易所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，香港联合交易所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场存在退市可能的上市公司根据

其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及\*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联合交易所市场没有风险警示板，香港联合交易所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得香港联合交易所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

## （2）股指期货等金融衍生品投资风险

投资于金融衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

投资股指期货可能面临如下风险：

1) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

2) 基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

3) 股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约。当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影响。

4) 期货盯市结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

5) 对手方风险：资产管理人运用基金资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

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

7) 到期日风险：指股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结

算价将基金财产持有的合约进行现金交割，基金财产无法继续持有到期合约的风险。

8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中国金融期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

### （3）参与融资业务的风险

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

### （4）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。转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。流动性风险是指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。信用风险是指本基金进行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等导致基金资产损失的风险。市场风险是指本基金持有的证券出借后，可能出现出借期间无法及时处置证券，而证券价格持续下跌导致基金资产损失的风险。

### （5）资产支持证券的风险

本基金可投资于资产支持证券，可能面临价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险是指市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险是指受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，从而存在流动性风险。信用风险是指可能因资产支持证券的债务人违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

### （6）投资存托凭证的风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

## 6、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影

响基金的收益水平。

#### 7、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级的变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。

#### 8、操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

#### 9、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法律法规及基金合同有关规定的风险。

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

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

#### 11、其他风险

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，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人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。

### （二）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，本基金还通过其他销售机构销售，但是，基金

并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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生效后执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效后5日内报中国证监会备案。

### （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、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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别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。

(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。

## 二十、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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检查；

（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及转融通；

（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；基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；
- （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条件得到有关资料的复印件；
- （18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管

人；

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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。

3、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》的规定安全保管可以保管的基金财产；

(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。

4、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可以保管的基金财产；

(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业监督管理机构，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。

5、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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6、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、申购款项及法律法规和《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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### 1、召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、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提高销售服务费率；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 13) 终止A类基金份额上市，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除外；
- 14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（2）在不违背法律法规规定和《基金合同》约定，对基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率和销售服务费率或变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而对《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) 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调整本基金的标的指数使用相关费用；

6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、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，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。

## 3、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，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

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

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

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

#### 4、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或通讯开会方式等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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

若到会者在权益登记日代表的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

3) 本人直接出具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二分之一（含二分之一）。

若本人直接出具意见或授权他人代表出具意见基金份额持有人所持有基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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意见或授权他人代表出具意见；

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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

（3）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人也可以采用网络、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。

## 5、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7条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### 2) 通讯开会

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

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、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，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会

议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具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。

## 7、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。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决定的事项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日内在指定媒介上公告。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。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### （三）基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1、《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生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告，并在决议生效后5日内报中国证监会备案。

#### 2、《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。

#### 3、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。

#### 4、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。

#### 5、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。

#### 6、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。

#### 7、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》产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其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,对仲裁各方当事人均具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

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

《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。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华宝基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心58楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心58楼

邮政编码：200120

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

成立日期：2003年3月7日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理

保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的股票、存托凭证和中国证监会核准发行上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金出于跟踪标的指数的需要，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。

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，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

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

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(4) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

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

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

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

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(9) 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%；

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

(11) 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；

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

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

(14) 本基金参与股指期货交易，应遵守下列要求：

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

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

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

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

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

(15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

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

(17) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，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；

(18) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的2%；

(19) 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；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

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

除上述第（2）、（6）、（11）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。



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

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

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

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

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

(1) 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网

下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

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

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

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

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

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

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

1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披

露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两日内编制临时报告书，予以公告。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

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

(6) 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

6、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。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

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

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本

托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人

1、基金管理人

2、基金管理人

3、基金管理人

### （四）基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人按照《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。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据相关登记结算公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

（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，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。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。

## 3、基金银行账户的开立和管理

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

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

（3）基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

## 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

(5) 账户注销时，由基金管理人依据中国证券登记结算公司相关规定，委托有交易关系的证券公司负责办理。销户完成后，基金管理人需将相关证明提供至基金托管人。账户注销期间如需基金托管人提供配合的，基金托管人应予以配合。

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

#### 5、债券托管专户的开设和管理

《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；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合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》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，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、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、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海

分公司/深圳分公司/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价值凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

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

#### （五）基金资产净值计算与复核

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。

基金管理人于每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

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

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

#### （七）争议解决方式

双方当事人同意，因本协议产生或与之相关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规

则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

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

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

##### 3、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) 将清算结果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。



#### （6）清算费用

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

#### （7）基金财产清算剩余资产的分配：

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

#### （8）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计、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。

#### （9）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、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。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资者更改个人信息资料，请及时到原开立华宝基金账户的销售机构更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮箱地址的前提下，基金管理人将根据投资者的需要寄送以下资料：

#### 1、认购确认书

在基金募集期间认购的，基金管理人将于基金合同生效后的3个工作日内向已经定制了电子对账单服务的投资者提供电子版认购确认书。如基金份额持有人因特殊原因需要获取纸质认购确认书，可拨打基金管理人客服电话400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金份额持有人免费邮寄纸质认购确认书。

#### 2、基金投资者对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金份额持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打我公司客服电话400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金份额持有人免费邮寄纸质对账单。

#### 3、其他相关的信息资料

基金管理人以说明或电子形式向投资人寄送基金其他信息资料。

### （二）定期定额投资计划

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务，即投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本基金开放申购赎回后公告。

### （三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金

管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

#### （四）在线服务

基金管理人利用基金管理人的网站（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）为基金投资者提供网上查询、网上资讯服务。

#### （五）资讯服务

1、投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，021-38924558，该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、50499667、50988055

#### 2、互联网站

基金管理人网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)

电子信箱：[fsf@fsfund.com](mailto:fsf@fsfund.com)

#### （六）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。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。

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

## 二十三、其他应披露事项

本报告期内，本基金在指定媒体刊登的公告如下：

| 公告日期       | 公告名称  |
|------------|---|
| 2020/04/24 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告             |
| 2020/04/21 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2020年第1季度报告                     |
| 2020/04/14 | 关于华宝现金宝货币基金 E 类份额转换、赎回转申购、定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告            |
| 2020/04/07 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）暂停申购赎回及定期定额投资业务的公告              |
| 2020/03/30 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年年度报告                       |
| 2020/03/30 | 华宝基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告                                 |
| 2020/03/14 | 华宝基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告                      |
| 2020/03/06 | 华宝基金关于旗下部分开放式基金新增东方财富证券为代销机构的公告                           |
| 2020/01/21 | 华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告                                 |
| 2020/01/21 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年第4季度报告                     |
| 2020/01/14 | 关于华宝基金管理有限公司旗下部分开放式基金 2020 年非港股通交易日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告    |
| 2019/11/30 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同                            |
| 2019/11/30 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）托管协议                            |
| 2019/11/30 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）                       |
| 2019/11/30 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要                     |
| 2019/11/30 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同信息披露有关条款的公告                       |
| 2019/11/21 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告          |
| 2019/11/21 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金更换会计师事务所的公告                             |
| 2019/10/22 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年第3季度报告                     |
| 2019/09/06 | 华宝基金关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告                                  |
| 2019/08/29 | 华宝基金关于旗下部分开放式基金新增国盛证券为代销机构的公告                             |
| 2019/08/29 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年半年度报告                      |
| 2019/08/29 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年半年度报告（摘要）                  |
| 2019/07/17 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）2019年第2季度报告                     |
| 2019/06/30 | 华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告                                      |
| 2019/06/22 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                             |
| 2019/06/18 | 关于华宝现金宝 E 货币基金定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告                        |
| 2019/06/12 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 |
| 2019/06/10 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）招募说明书（摘要）（更新）                   |

|            |  |
|------------|--|
| 2019/05/13 | 华宝基金管理有限公司关于华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）增加C类基金份额并修改基金合同的公告 |
|------------|--|

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的办公场所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

（一）中国证监会准予华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）募集注册的文件

（二）《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）基金合同》

（三）《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金（LOF）托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2021年3月31日