

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金  
更新的招募说明书  
(2020年第3号)

基金管理人：华安基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇二〇年十二月

## 重要提示

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

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

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

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本招募说明书中涉及托管业务的相关内容已经本基金托管人复核。本次招募说明书仅根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规以及本基金的《基金合同》、《托管协议》，对所涉章节进行了更新，相关信息更新截止日为2020年12月19日。除特别说明外，本招募说明书其他所载内容截止日为2020年11月2日，有关财务数据截止日为2019年3月31日，净值表现截止日为2018年12月31日。

## 目 录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	9
四、基金托管人 .....	20
五、相关服务机构 .....	25
六、基金的募集 .....	35
七、基金合同的生效 .....	36
八、基金份额折算和变更登记 .....	37
九、基金份额的交易 .....	38
十、基金份额的申购与赎回 .....	40
十一、基金的投资 .....	50
十二、基金的业绩 .....	64
十三、基金的财产 .....	66
十四、基金资产的估值 .....	68
十五、基金的收益与分配 .....	73
十六、基金的费用与税收 .....	75
十七、基金的会计与审计 .....	79
十八、基金的信息披露 .....	80
十九、风险揭示 .....	86
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	91
二十一、基金合同的内容摘要 .....	94
二十二、基金托管协议的内容摘要 .....	95
二十三、对基金份额持有人的服务 .....	96
二十四、其他应披露事项 .....	97

二十五、招募说明书存放及查阅方式 .....	100
二十六、备查文件 .....	101
附件一：基金合同内容摘要 .....	102
附件二：托管协议内容摘要 .....	119

## 一、绪言

《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《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运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关规定以及《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 本合同、《基金合同》：《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充；
- 中国：中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）；
- 法律法规：中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布，2013 年 6 月 1 日实施的《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；
- 《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订；
- 《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

- 元：中国法定货币人民币元；
- 基金或本基金：依据《基金合同》所募集的上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金；
- 招募说明书：《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新；
- 托管协议：基金管理人与基金托管人签订的《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
- 发售公告：《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》；
- 交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”；
- 联接基金：指将其绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的本基金,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作的基金；
- 中国证监会：中国证券监督管理委员会；
- 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会；
- 基金管理人：华安基金管理有限公司；
- 基金托管人：中国工商银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
- 发售代理机构：符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；
- 发售协调人：由基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理

机构：	
申购赎回代理券商：	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司；
代销机构：	发售代理机构和/或申购赎回代理券商；
直销机构：	华安基金管理有限公司；
销售机构：	直销机构和/或代销机构；
基金销售网点：	直销机构的直销中心和/或代销机构的代销网点；
登记结算业务：	《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、过户、清算和结算业务；
登记结算机构：	中国证券登记结算有限责任公司；
《基金合同》当事人：	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
个人投资者：	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人；
机构投资者：	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织；
合格境外机构投资者：	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
投资者：	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称；
基金合同生效日：	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，



	基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日；
募集期：	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限；
基金存续期：	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间；
日/天：	公历日；
月：	公历月；
工作日：	上海证券交易所的正常交易日；
开放日：	销售机构办理本基金份额申购、赎回或其他业务的工作日；
T 日：	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日；
T+n 日：	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）；
认购：	在本基金募集期内投资者申请购买本基金基金份额的行为；
发售：	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为；
申购：	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人申请购买基金份额的行为；
赎回：	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为；
申购、赎回清单：	由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价：	投资者申购基金份额时，按《基金合同》和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
赎回对价：	基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按《基金合同》和招募说明书规定应交付给该基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；

- 标的指数： 本基金跟踪的基准指数，是由上海证券交易所发布的上证龙头企业指数及其未来可能发生的变更；
- 完全复制法： 一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的；
- 最小申购、赎回单位： 本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍；
- 组合证券： 本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
- 现金替代： 申购、赎回过程中，投资者按《基金合同》和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
- 现金差额： 最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
- 基金份额参考净值： 指上海证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV；
- 预估现金部分： 指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额；
- 基金账户： 基金登记结算机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户： 各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

指定交易：	《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”；
基金份额折算：	基金管理人根据《基金合同》规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为；
基金利润：	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；
基金收益评价日：	基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之基准日；
基金累计报酬率：	基金收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
标的指数同期累计报酬率：	收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
基金资产总值：	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；
基金资产净值：	基金资产总值扣除负债后的净资产值；
基金份额净值：	计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值；
基金资产估值：	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程；
货币市场工具：	现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具；
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在

10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

指定媒体：中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；

不可抗力：本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998 年 6 月 4 日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：(021) 38969999
- 11、客户服务电话：40088-50099
- 12、联系人：王艳
- 13、网址：www.huaan.com.cn

#### (二) 注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5 亿元人民币
- 2、股权结构

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

#### (三) 主要人员情况

- 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、

学历及兼职情况等。

(1) 董事会

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

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

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁，上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司监事会主席。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁，上海锦江资本股份有限公司执行董事、首席执行官，上海锦江国际投资管理有限公司董事长，Radisson Hospitality AB 董事长，华安基金管理有限公司董事，长江养老保险股份有限公司董事，史带财产保险股份有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、战略投资及直投业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略发展部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事

长、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

独立董事：

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

朱宁先生，博士研究生学历，教授。2003年至2010年在美国加州大学（戴维斯分校）担任助理教授、终身教授，主要从事经济金融教学研究等工作；2010年至今在上海交通大学上海高级金融学院担任副院长、金融学教授，主要从事经济金融教学研究等工作。

## （2）监事会

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

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

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

## （3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，21 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生，20 年金融、基金行业从业经验。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

翁启森先生，硕士研究生学历，26 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，16 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，21 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

## 2、本基金基金经理

现任基金经理：

苏卿云先生，硕士研究生，11 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月起，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及本基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任



本基金及其联接基金的基金经理。2018年9月起，同时担任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年10月起，同时担任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年11月，同时担任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年1月起，同时担任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年3月起，同时担任华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

刘璇子女士，硕士研究生，6年证券行业从业经历。2014年7月应届毕业生加入华安基金，曾任企业发展部业务发展经理、指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020年11月起，同时担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金及本基金的基金经理。

历任基金经理：

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

徐宜宜先生，自2010年11月18日至2012年12月22日担任本基金基金经理。

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

3、本公司采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

张霄岭先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

崔莹先生，基金投资部总监

上述人员之间不存在亲属关系。

#### 4、业务人员的准备情况

截至 2020 年 9 月 30 日，公司目前共有员工 378 人（不含子公司），其中 59.5%具有硕士及以上学历，93.1%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

#### （四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

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

#### （五）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基

金法》及相关法律法规的行为的发生；

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除为基金管理人进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

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

#### 5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 除为基金管理人进行基金投资外，不直接或间接进行其他股票交易，也不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

## 1、内部控制的原则

### (1) 健全性原则

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

### (2) 有效性原则

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

### (3) 独立性原则

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

### (4) 相互制约原则

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

### (5) 成本效益原则

公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 2、内部控制的组织体系

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

(1) 董事会：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

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

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

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

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

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

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

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

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

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

### 4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### (1) 控制环境

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

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

#### (2) 风险评估

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

### （3）控制活动

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

#### ① 组织结构控制

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

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

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

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

#### ② 操作控制

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

#### ③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会

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

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

#### （4）信息沟通

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

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

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

#### （5）内部监控

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

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

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

### 5、基金管理人内部控制制度声明

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

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

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

### （二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项



最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

##### 1、内部风险控制目标

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

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

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

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

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

益最大化目的。

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

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

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

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

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

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

部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构及其联系人

#### 1、申购赎回代办证券公司（简称：一级交易商）：

##### (1) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

电话：(021) 38676798

传真：(021) 38670798

客户服务电话：400-8888-666

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

##### (2) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：(010) 65183888

传真：(010) 65182261

客户服务电话：95587

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

##### (3) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：(0755) 82130833-2181

传真：(0755) 82133952

客户服务电话：95536

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

##### (4) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82944669

客户服务热线：95565

网站：www.newone.com.cn

(5) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

电话：(010) 66568047

传真：(010) 66568536

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(6) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 23219000

传真：(021) 63410627

客户服务电话：400-8888-001、95553

网址：www.htsec.com

(7) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：(021) 96250500

网址：www.swhysc.com

(8) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419974

传真：(021) 68419867

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(9) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：尤习贵

电话：400-8888-999

客户服务电话：95579

网址：www.cjsc.com

(10) 安信证券股份有限公司

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

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：王连志

电话：(0755) 82825551

传真：(0755) 82558355

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

(11) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

电话：023-63786433

传真：023-63786477

客户服务电话：40080-96096

网址：www.swsc.com.cn

(12) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层

法定代表人：侯巍

电话：(0351) 8686966

传真：(0351) 8686667

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn

(13) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

电话：(010)66555171

传真：(010)66555397

客户服务电话：(010) 66555835

网址：www.dxzq.net.cn

(14) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州市工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州市工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：(0512) 62601555

传真：(0512) 62938812

客户服务电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn



(15) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

客户服务电话：400-800-8899

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

(16) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-23层、25层—29层、32、36、39、40层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326010

客户服务电话：95503

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

(17) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16/17层

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

法定代表人：丁益

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83516199

客户服务电话：400-6666-888

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

(18) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：张瑾

电话：(021) 53519888

传真：(021) 53519888

客户服务电话：4008918918

网址：www.shzq.com

(19) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号，国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：姚志勇

电话：(0510) 82831662

传真：(0510) 82830162

客户服务电话：(0510) 82588168

网址：www.glsc.com.cn

(20) 恒泰证券股份有限公司

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

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

法定代表人：庞介民

电话：(0471) 4913998

传真：(0471) 4930707

客户服务电话：0471-4960762

网址：www.cnht.com.cn

(21) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

传真：(0531) 68889752

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(22) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

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

法定代表人：王宜四

电话：(0791) 6768763

传真：(0791) 6789414

客户服务电话：4008866567

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

(23) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼

法定代表人：姚文平

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客户服务电话：4008888128

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

(24) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：96326

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

(25) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人：况雨林

电话：(0871) 3577930

传真：(0871) 3578827

客户服务电话：(0871) 63577930

网址：www.hongtazq.com

(26) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 4 号楼 11 层国融证券

法定代表人：张智河

电话：(0471) 6292587

传真：(0471) 6292477

网址：<http://www.grzq.com>

(27) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：(0451)82336863

传真：(0451)82287211

客户服务电话：40066-62288

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

(28) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122107

传真：(021) 50122078

客户服务电话：4008209898

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

(29) 天风证券有限责任公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：武汉市武昌区中南路 99 号武汉保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

电话：(027) 87618889

传真：(027) 87618863

客户服务电话：(028) 86712334

网址：www.tfzq.com

(30) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40 层-43 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40 层-43 层

法定代表人：赵大建

客服电话：400-889-5618

网址：http://www.e5618.com

## 2、二级市场交易代办证券公司

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

### (二) 登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

电话：(021) 68870676

传真：(021) 68870064

联系人：李健

### (三) 律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358716

联系人：秦悦民

经办律师：秦悦民、王利民

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张青萌

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

## 六、基金的募集

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

本基金自 2010 年 10 月 25 日起向全社会公开募集，截至 2010 年 11 月 12 日募集工作顺利结束。

本基金是交易型、开放式、股票型证券投资基金，基金存续期间为不定期。

本基金的募集方式有网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 1,130,323,223.00 元人民币（含所募集股票市值），认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 22,600.00 元人民币。募集资金已于 2010 年 11 月 18 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集股票已于 2010 年 11 月 17 日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为 10,710 户。按照每份基金份额初始发售面值 1.00 元人民币计算，设立募集期间募集（含所募集股票市值）的有效份额共计 1,130,323,223 份基金份额，利息结转的基金份额为 22,600 份基金份额。两项合计共 1,130,345,823 份基金份额，已全部计入本基金基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。其中，华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）以及本公司基金从业人员没有认购本基金。按照有关法律规定，本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

## 七、基金合同的生效

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



## 八、基金份额折算和变更登记

根据《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，本基金管理人决定对本基金进行基金份额折算与变更登记，并决定2010年12月17日为本基金的基金份额折算日。当日上证龙头企业指数收盘值为2,626.685点，本基金的基金资产净值为1,137,752,523.50元，折算前基金份额总额为1,130,345,823份，折算前基金份额净值为1.007元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.38320263（以四舍五入的方法保留到小数点后8位），折算后基金份额总额为433,150,796.00份，折算后基金份额净值为2.627元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2010年12月20日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位，由此产生的误差计入基金资产。投资者可以自2010年12月21日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

## 九、基金份额的交易

### （一）基金份额上市

根据有关规定，本基金基金合同生效后，具备上市条件，于2011年1月10日起在上海证券交易所上市交易。

### （二）基金份额的上市交易

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

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍，不足100份的部分可以卖出；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元；
- 5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

### （三）终止上市交易

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

- 1、不再具备本条第（一）款规定的上市条件；
- 2、《基金合同》终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、《基金合同》约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止本基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

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

若因上述1、4项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止

上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接跟踪本基金同一标的指数的非上市开放式指数基金。

#### （四）基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，上海证券交易所开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

##### 1、基金份额参考净值计算公式为：

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

##### 2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

##### 3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

## 十、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

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

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金在上市交易之前可开始办理申购。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购。

本基金已于2011年1月10日起，开始办理申购、赎回业务。

#### 2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午9:30-11:30 和下午1:00-3:00。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若出现上海证券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体上公告。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定；
- 5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益、不违背上海证券交易所相关规则的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人

网站公告并报中国证监会备案。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商的规定，在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者在提交赎回申请时，其必须持有足够的基金份额余额和现金。

##### 2、申购和赎回申请的确认

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

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用于上海证券交易所和登记结算机构的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收。申购、赎回发生的现金替代款和现金差额分别于T+1日和T+2日交收，基金托管人根据登记结算机构的结算通知或基金管理人的划款通知办理资金的划拨。如果登记结算机构、基金管理人、申购赎回代理券商之间在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定和其他相关约定进行处理。如登记结算机构相关的清算交收规则发生变化，则按最新规定办理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （五）申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额须为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金的最小申购、赎回单位为50万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种指定媒体公告。

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

#### （六）申购、赎回的对价和费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给申请赎回的基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。申购、赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

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

#### （七）申购、赎回清单的内容与格式

##### 1、申购、赎回清单的内容

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

##### 2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将

公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

### 3、现金替代相关内容

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

(1) 现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

#### (2) 可以现金替代

①适用情形：出于证券停牌等原因导致投资者无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

该证券参考价格目前确定原则为：

(i) 该证券正常交易时，采用最新成交价。

(ii) 该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格。

(iii) 该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价。

(iv) 该证券停牌且当日无成交时，采用前收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

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

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该部分证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买入该部分

证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

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

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

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

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

若现金替代日（T日）后至T+2日（在特殊情况下则为T日起的第20个正常交易日）期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股，以及由于股权分置改革等发生的其他权益变动，则进行相应调整。

T+2日后的第1个工作日（在特殊情况下则为T日起的第21个市场交易日），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收，将于此后3个工作日内完成。

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

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

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规



定的参考价格为准。

参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券，或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

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

## 4、预估现金部分相关内容

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

T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分，其计算公式为：

$T日预估现金部分 = T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价相乘之和)$

其中，T日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

## 5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

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

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

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

#### 6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	2014年5月16日
基金名称	上证龙头交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华安基金管理有限公司
一级市场基金代码	510191

20140515 信息内容	
现金差额(单位:元)	-12799.52
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)	997299.48
基金份额净值(单位:元)	1.995

20140516 信息内容	
预估现金部分(单位:元)	-12776.52
现金替代比例上限	50%
是否需要公布 IOPV	公布
最小申购、赎回单位(单位:份)	500000
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

成份股信息内容					
股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
600011	华能国际	3800	允许	10.00%	
600018	上港集团	800	允许	10.00%	
600028	中国石化	10600	允许	10.00%	
600030	中信证券	800	允许	10.00%	
600031	三一重工	1300	允许	10.00%	
600036	招商银行	11300	允许	10.00%	

600048	保利地产	3100	允许	10.00%	
600050	中国联通	9400	允许	10.00%	
600060	海信电器	500	允许	10.00%	
600100	同方股份	500	允许	10.00%	
600104	上汽集团	3800	允许	10.00%	
600138	中青旅	200	允许	10.00%	
600177	雅戈尔	600	允许	10.00%	
600196	复星医药	200	允许	10.00%	
600271	航天信息	200	允许	10.00%	
600292	中电远达	100	允许	10.00%	
600315	上海家化	100	允许	10.00%	
600340	华夏幸福	200	允许	10.00%	
600362	江西铜业	1400	允许	10.00%	
600383	金地集团	3100	允许	10.00%	
600401	海润光伏	100	允许	10.00%	
600415	小商品城	200	允许	10.00%	
600439	瑞贝卡	100	允许	10.00%	
600487	亨通光电	100	允许	10.00%	
600498	烽火通信	100	允许	10.00%	
600518	康美药业	200	允许	10.00%	
600519	贵州茅台	100	允许	10.00%	
600522	中天科技	200	允许	10.00%	
600535	天士力	100	允许	10.00%	
600547	山东黄金	500	允许	10.00%	
600575	芜湖港	1000	允许	10.00%	
600585	海螺水泥	700	允许	10.00%	
600637	百视通	100	允许	10.00%	
600667	太极实业	300	允许	10.00%	
600690	青岛海尔	1000	允许	10.00%	
600694	大商股份	300	允许	10.00%	
600718	东软集团	100	允许	10.00%	
600741	华域汽车	1000	允许	10.00%	
600795	国电电力	5700	允许	10.00%	
600804	鹏博士	100	允许	10.00%	
600809	山西汾酒	100	允许	10.00%	
600827	友谊股份	700	允许	10.00%	
600832	东方明珠	100	允许	10.00%	
600837	海通证券	900	允许	10.00%	
600859	王府井	200	允许	10.00%	
600880	博瑞传播	100	允许	10.00%	
600884	杉杉股份	100	允许	10.00%	

600887	伊利股份	200	允许	10.00%	
600900	长江电力	1400	允许	10.00%	
601006	大秦铁路	2200	允许	10.00%	
601088	中国神华	2400	允许	10.00%	
601098	中南传媒	100	允许	10.00%	
601111	中国国航	1800	允许	10.00%	
601186	中国铁建	7900	允许	10.00%	
601231	环旭电子	100	允许	10.00%	
601288	农业银行	17000	允许	10.00%	
601318	中国平安	3300	允许	10.00%	
601398	工商银行	12800	允许	10.00%	
601601	中国太保	1400	允许	10.00%	
601607	上海医药	700	允许	10.00%	
601628	中国人寿	500	允许	10.00%	
601633	长城汽车	100	允许	10.00%	
601668	中国建筑	29000	允许	10.00%	
601688	华泰证券	300	允许	10.00%	
601857	中国石油	2300	允许	10.00%	
601888	中国国旅	100	允许	10.00%	
601928	凤凰传媒	100	允许	10.00%	
601933	永辉超市	400	允许	10.00%	
603000	人民网	100	允许	10.00%	

#### （八）暂停申购、赎回的情形

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
- 2、因特殊原因（如上海证券交易所决定临时停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；
- 4、上海证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回；
- 5、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单；
- 6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购、赎回申请的措施；
- 7、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购、赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并及时公告。赎回申请被全部或部分拒绝的，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。

#### （九）集合申购和其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购赎回单位或其整数倍，进行申购，并有权制定集合申购业务的相关规则。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前的至少3个工作日予以公告。

基金管理人指定的申购赎回代理券商可依据法律法规和本合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（含存托凭证）、新股（含存托凭证）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

### （三）投资理念

中国经济和资本市场将保持长期稳定发展，指数化投资可以以较低成本获得市场平均水平的长期回报。本基金遵循指数化投资理念，以具有行业代表性、流动性和蓝筹特性的上证龙头企业指数作为标的指数，通过完全复制法实现跟踪偏离度与跟踪误差的最小化，给投资者带来与标的指数涨跌幅相近的回报。同时，为投资者提供一种管理透明、低成本、分散程度高的投资工具，满足投资者多样化的投资需求。

### （四）标的指数

本基金的标的指数为上证龙头企业指数。

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

## （五）投资策略

本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票（含存托凭证）加以替换。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

本基金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。

## （六）投资管理

### 1、投资决策依据

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

### 2、投资决策体系

本基金管理人实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明确和运作规范。投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，投资协调小组是基金投资的协调机构和中间桥梁，投资协调小组由基金投资部、研究发展部、固定收益部的负责人及业务骨干组成。基金经理是基金运作的直接管理人。

### 3、投资管理程序

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

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

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

(3) 组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：集中交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

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

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

(7) 合规监察：合规与监察稽核部对整个投资管理流程进行实时监控。

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

## (七) 投资组合管理

### 1、投资组合的构建

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三个步骤：确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

(1) 确定目标组合：基金管理人主要采用完全复制成份股及其权重的方法



确定目标组合。

(2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司行为、基本面、交易成本等因素的分析，确定合理的建仓策略。

(3) 组合调整：基金经理在合理时间内，采用适当的手段和措施，对实际投资组合进行动态调整，直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

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

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。

## 2、投资组合的日常管理

### (1) 标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司行为信息，如股本变化、分红、停牌、复牌，以及成份股公司其它重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

### (2) 标的指数的跟踪与分析

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

### (3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金每日申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购和赎回。

### (4) 投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析

基金经理跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因，并对拟调整的成份股的流动性进行分析。

### (5) 投资组合调整

如发生标的指数成份股调整、成份股公司发生兼并、收购和重组等重大事件，基金经理将利用数量化投资分析模型，分析并确定组合调整策略，及时进行组合的优化调整，减少流动性冲击，以实现更好的跟踪标的指数的目的。

#### (6) 基金每日申购、赎回清单的制作

基金经理以T-1日标的指数成份股的构成及其权重为基础，结合基金当前持有的证券组合及其比例，并考虑T日将发生的上市公司变动等情况，制作T日基金申购、赎回清单并予以公告。

### 3、投资组合的定期管理

本基金投资组合的定期管理内容主要包括以下几个方面：

#### (1) 每月

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

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

#### (2) 每半年

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

### 4、投资绩效评估

本基金的投资绩效评估主要包括以下几个方面：

(1) 每日分析基金组合与标的指数的跟踪偏离度；

(2) 定期（每月末、每季度末）对本基金的运作情况进行量化评估；

(3) 基金经理根据定期量化评估报告，分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等，优化跟踪偏离度管理方案。

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

### 5、其他金融工具投资策略

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

金资产，提高基金资产的投资收益。

## （八）投资限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

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

### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金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%；
- （2）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- （3）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （4）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净

值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(6) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

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

(8) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

除上述(4)、(5)项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

#### (九) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即上证龙头企业指数。

如果中证指数有限公司变更或停止上证龙头企业指数的编制及发布、或上证龙头企业指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致上证龙头企业指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，有权变更本基金的标的指数，并相应地变更业绩比较基准。

#### (十) 风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数

的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

(十一) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

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

(十二) 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

(十三) 基金的投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	96,507,685.81	98.16
	其中：股票	96,507,685.81	98.16
2	固定收益投资	218,000.00	0.22
	其中：债券	218,000.00	0.22
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,382,584.15	1.41
7	其他各项资产	209,327.51	0.21
8	合计	98,317,597.47	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	542,830.64	0.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	542,830.64	0.55

## 2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	3,248,848.58	3.32
C	制造业	35,209,526.59	35.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,497,509.00	3.57
E	建筑业	2,218,712.12	2.26
F	批发和零售业	8,519,754.73	8.69
G	交通运输、仓储和邮政业	5,201,905.86	5.31
H	住宿和餐饮业	1,313,521.00	1.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,456,953.32	8.63
J	金融业	16,475,862.13	16.81
K	房地产业	3,826,640.88	3.91
L	租赁和商务服务业	3,869,638.96	3.95
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	1,473,450.00	1.50
R	文化、体育和娱乐业	2,652,532.00	2.71
S	综合	-	-

合计	95,964,855.17	97.93
----	---------------	-------

### 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 3.1 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	600682	南京新百	110,404	1,779,712.48	1.82
2	601231	环旭电子	111,700	1,720,180.00	1.76
3	600519	贵州茅台	1,955	1,669,550.45	1.70
4	603833	欧派家居	13,700	1,663,180.00	1.70
5	600816	安信信托	224,672	1,624,378.56	1.66
6	600030	中信证券	64,652	1,602,076.56	1.63
7	600588	用友网络	47,000	1,593,300.00	1.63
8	600309	万华化学	34,900	1,588,997.00	1.62
9	600584	长电科技	109,051	1,538,709.61	1.57
10	600438	通威股份	121,300	1,475,008.00	1.51

#### 3.2 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

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	600485	信威集团	86,438	542,830.64	0.55

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------



1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	218,000.00	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	218,000.00	0.22

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	110054	通威转债	1,590	159,000.00	0.16
2	110056	亨通转债	590	59,000.00	0.06

**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投资。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 11 投资组合报告附注

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

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

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	872.07
2	应收证券清算款	208,136.79
3	应收股利	-

4	应收利息	318.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,327.51

#### 11.4 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。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

##### 11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	542,830.64	0.55	重大资产重组

## 十二、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2018 年 12 月 31 日）

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	② - ③	② - ④
2018年1月1日至2018年12月31日	-26.25%	1.36%	-27.33%	1.38%	1.08%	-0.02%
2017年1月1日至2017年12月31日	16.70%	0.57%	15.82%	0.58%	0.88%	-0.01%
2016年1月1日至2016年12月31日	-10.51%	1.47%	-11.08%	1.49%	0.57%	-0.02%
2015年1月1日至2015年12月31日	20.25%	2.51%	21.88%	2.52%	-1.63%	-0.01%
2014年1月1	40.76%	1.01%	40.18%	1.01%	0.58%	0.00%

日至2014年 12月31日						
2013年1月1 日至2013年 12月31日	-10.08%	1.28%	-12.64%	1.27%	2.56%	0.01%
2012年1月1 日至2012年 12月31日	14.30%	1.12%	12.53%	1.12%	1.77%	0.00%
2011年1月1 日至2011年 12月31日	-19.31%	1.14%	-19.42%	1.15%	0.11%	-0.01%
自基金成立 (2010年11 月18日)至 2010年12月 31日	-2.10%	0.75%	-2.38%	1.17%	0.28%	-0.42%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 十三、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。

其构成主要有：

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基

金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、登记结算机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

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

### （四）估值程序

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

### （五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；



(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经

相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人  
对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。当估值  
或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施  
防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人  
应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人  
应当公告，并报中国证监会备案。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计  
算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同  
行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规  
定执行。

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

##### 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

(4) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金

份额净值计算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。

#### (七) 暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;

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

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

5、中国证监会认定的其他情形。

#### (八) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

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

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式采用现金分红；
- 3、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，基金管理人可以进行收益分配；
- 4、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；若《基金合同》生效不满3个月，可不进行收益分配；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （二）基金收益分配数额的确定原则

- 1、在基金收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率 = (收益评价日基金份额净值 ÷ 基金上市前一日基金份额净值 - 1) × 100%，(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)

标的指数同期累计报酬率 = (收益评价日标的指数收盘值 ÷ 基金上市前一日标的指数收盘值 - 1) × 100%，(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率 = 基金累计报酬率 - 标的指数同期累计报酬率

当超额收益率超过1%时，基金管理人有权进行收益分配。

- 2、根据前述收益分配原则计算截至收益分配评价日本基金的份额可分配收益，并确定收益分配比例。

- 3、每基金份额的应分配收益为份额可分配收益乘以收益分配比例，保留小

数点后3位，第4位舍去。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益评价日基金份额可分配收益、基金收益分配对象、分配时间、份额分配金额、分配方式等内容。

### （四）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，在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

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

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、与基金运作有关的费用

##### （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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## （3）基金的标的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提，不满一个季度的，根据实际使用天数支付。指数许可使用费适用比例费率时，计算方法如下：

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

H为每日计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

具体就每个计费季度而言，当季度日均基金资产净值(日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同)大于人民币5000万元时，指数许可使用费不足3.5万元的，按照3.5万元收取。

当季度日均基金资产净值小于或等于人民币5000万元的，指数许可使用的按照按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。

指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，按季支付。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 2、与基金销售有关的费用



### （一）申购、赎回费用

投资者在申购或赎回基金份额时，需按照本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

申购/赎回佣金=申购/赎回份额×佣金比率

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资者申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）费用调整

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

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

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，应通报基金托管人。更换会计师事务所需在按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 十八、基金的信息披露

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

### (二) 信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

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

### (三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

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

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

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

### 2、基金份额发售公告

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

### 3、《基金合同》生效公告

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

### 4、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

根据投资需要或为提高交易便利，基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金管理人确定基金份额折算日后应提前2日将基金份额折算日公告登载于指定媒体上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理

人将在3日内将基金份额折算结果公告登载于指定媒体上。

#### 5、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前2日在指定媒体上公告。

#### 6、基金份额上市交易公告书

本基金基金份额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3个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒体上。

#### 7、基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告

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

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

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

#### 8、申购、赎回清单

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

#### 9、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

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

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

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

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人

主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

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

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

## 10、临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

(14) 重大关联交易事项；

(15) 基金收益分配事项；

(16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；

(18) 基金改聘会计师事务所；

(19) 变更基金销售机构；

(20) 更换登记结算机构；

(21) 本基金开始办理申购、赎回；

(22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(23) 本基金变更标的指数；

(24) 本基金暂停接受申购、赎回申请；

(25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

(26) 本基金暂停上市、恢复上市或终止上市

(27) 本基金推出新业务或服务；

(28) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

(29) 中国证监会规定的其他事项。

## 11、澄清公告

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

## 12、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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前40日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管



人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

13、中国证监会规定的其他信息。

#### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

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

## 十九、风险揭示

### （一）市场风险

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、投资者心理等市场因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

### （二）流动性风险评估及流动性风险管理工具

在调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”章节。

#### （2）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1) 基金合同约定：“本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股”，其中“投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%”，本基金的标的指数为上证龙头企业指数，从投资范围上看，基金资产的流动性良好；

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

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

#### （3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

1) 暂停接受赎回申请

具体措施，详见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“(八) 暂停申购、赎回的情形”的相关内容。

2) 延缓支付赎回款项/对价或延期办理

具体措施，详见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“(八) 暂停申购、赎回的情形”等相关内容。

3) 暂停基金估值

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

4) 中国证监会认定的其他措施。

(三) 基金投资组合收益与标的指数收益偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

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

2、由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3、成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

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

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

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

#### （四）标的指数变更的风险

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

#### （五）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### （六）参考IOPV 决策和IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### （七）退市风险

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

#### （八）投资者申购失败的风险

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

#### （九）投资者赎回失败的风险

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

份额。

#### （十）基金份额赎回对价的变现风险

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

#### （十一）存托凭证的投资风险

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

#### （十二）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

2、登记结算机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3、证券交易所、登记结算机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### （十三）管理风险与操作风险

基金管理人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险。例如，申购与赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

#### （十四）技术风险

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

#### （十五）不可抗力

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

声明：

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

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

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- (1) 更换基金管理人；
- (2) 更换基金托管人；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的情形除外；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- (9) 终止《基金合同》；
- (10) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- (11) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- (12) 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。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 基金管理人、上海证券交易所和登记结算机构在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关本基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，基金管理人应在中国证监会核准后依照《信息披露管理办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

## (二) 《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《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》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；



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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目。

基金管理人提供的服务内容如下：

### 1、客户服务热线

客服热线自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询系统，投资者可通过电话收听最新公告、基金份额净值等信息。客服热线人工服务在交易日提供人工咨询服务，一对一为投资者解答基金投资疑问。

华安客户服务热线：40088-50099。

### 2、网上服务

网上在线客服为投资者提供在线交流的互动平台，是投资者实时咨询的又一通道。投资者也可以通过登录网站，查询基金相关资料。

### 3、客户投诉处理

投资者可以通过基金管理人提供的客服热线投诉处理专席、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人提供的服务进行投诉。投资者还可以通过发售代销机构、申购赎回代理券商的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

### 4、网址及电子信箱

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

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

## 二十四、其他应披露事项

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

### 2. 本期公告事项

序号	公告事项	信息披露报纸名称	披露日期
1	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2018.12.07
2	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2018.12.12
3	华安基金关于参加君德汇富优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2018.12.21
4	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2018.12.28
5	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2019年第1号）	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2019.01.02
6	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2019年第1号）	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》	2019.01.02

		和公司网站	
7	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《证券时报》 和公司网站	2019.01.21
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“信威集团”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》、 《证券日报》 和公司网站	2019.03.06
9	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》、 《证券日报》 和公司网站	2019.03.29
10	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》、 《证券日报》 和公司网站	2019.03.29
11	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告	公司网站	2019.03.30
12	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	《证券时报》 和公司网站	2019.03.30
13	关于华安基金撤销沈阳业务部的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》、 《证券日报》 和公司网站	2019.04.10
14	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报	《证券时报》	2019.04.20

	告	和公司网站	
--	---	-------	--

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

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



## 二十六、备查文件

### （一）备查文件

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

（二）存放地点：基金管理人的住所。

（三）查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年十二月二十三日

## 附件一：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集基金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、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、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《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) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，决定和调整除调高管理费率及托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

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

(14) 在法律法规允许的前提下，为本基金的利益依法为本基金进行融资融

券；

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

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

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回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资产净值，确定基金份额申购、赎回的对价；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季报、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及

报告义务；

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

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

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能

生效，基金管理人承担因募集产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还认购本基金基金份额的投资者；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

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

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

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

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表本基金签订的与本基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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



提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
  - (2) 更换基金管理人；
  - (3) 更换基金托管人；
  - (4) 转换基金运作方式；
  - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的情形除外；
  - (6) 变更基金类别；
  - (7) 本基金与其他基金的合并；
  - (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - (9) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
  - (10) 变更基金份额持有人大会程序；
  - (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
  - (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
  - (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
  - (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
  - (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
  - (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4)基金管理人、上海证券交易所和登记结算机构在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关本基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前

30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前40天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯开会等方式。

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代

表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交

符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

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

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

人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

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

## 2、议事程序

### （1）现场开会

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

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

### （2）通讯开会

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

### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大

会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

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

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《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。

### （二）基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内



成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月。

(三) 清算费用

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

(四) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(五) 基金财产清算的公告

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

#### （六）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议解决方式

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 附件二：托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

法定代表人：朱学华

成立时间：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号

注册资本：1.5亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金设立，基金业务管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：（021）38969999

传真：（021）58406389

联系人：冯颖

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

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

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据

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

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（含存托凭证）、新股（含存托凭证）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

①按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

②根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:

a、本基金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%;

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

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

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

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

f、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

g、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

③法规允许的基金投资比例调整期限

除上述 d、e 项外,由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

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

④本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

⑤本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管部门另有要求的除外。

⑥相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

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

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

①承销证券；

②向他人贷款或提供担保；

③从事可能使基金承担无限责任的投资；

④买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

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

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

⑦从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

⑧当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

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

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系

的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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

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

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

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

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

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

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

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

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

(7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

②此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受



限证券。

③基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

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

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

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

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

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

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

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

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

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

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

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

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

## （二）基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反

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

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

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

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

### 三、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

## （二）募集资金的验证

基金募集期内，基金管理人将网下发售的认购资金划入基金管理人在银行开设的基金募集专户；发售代理机构网下和网上现金认购结束，登记结算机构应将现金认购的资金划入发售协调人指定账户，由发售协调人划入基金管理人开设的基金募集专户；网下股票认购结束，登记结算机构应根据基金管理人提供的资料对募集的股票进行冻结。

基金募集期满或基金停止募集时，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金资金专户中，基金募集的股票存放在以基金托管人和基金联名方式开立的证券账户下。

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募集资金的退款和募集股票的解冻事宜，基金托管人应提供充分协助。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

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

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

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

## （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分

公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

（五）投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的交收指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代、现金差额的结算。现金替代的退款和补款由基金管理人负责办理。

（六）债券托管账户的开立和管理

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

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

（七）其他账户的开设和管理

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

（八）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人或其委托的第三方实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（九）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金

托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

#### 四、基金资产净值计算和会计核算

##### （一）基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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

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

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

##### （二）基金资产估值方法

##### 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

##### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

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

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

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

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（6）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。

（7）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。

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

### (三) 估值差错处理

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

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

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

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

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

### (四) 基金账册的建立

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



经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金定期报告的编制和复核

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

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

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

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

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

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管

理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 五、基金份额持有人名册的保管

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限公司担任本基金的登记结算机构，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由登记结算机构承担。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结算机构提供，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半年报和年报前，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。

## 六、争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。