

安信中证复兴发展 100 主题指数型  
证券投资基金  
更新招募说明书  
(2019 年第 1 号)

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的募集申请于 2018 年 2 月 2 日经中国证监会证监许可[2018]247 号文注册。本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 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。

安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金（以下简称“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。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金基金份额分为 A 类份额和 C 类份额，其中 A 类份额收取认（申）购费，C 类份额不收取认（申）购费，但计提销售服务费。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金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引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 6 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	9
第四部分 基金托管人.....	19
第五部分 相关服务机构.....	22
第六部分 基金的募集.....	39
第七部分 基金合同的生效.....	40
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	41
第九部分 基金的投资.....	53
第十部分 基金的业绩.....	67
第十一部分 基金的财产.....	68
第十二部分 基金资产的估值.....	69
第十三部分 基金的收益与分配.....	74
第十四部分 基金费用与税收.....	76
第十五部分 基金的会计与审计.....	79
第十六部分 基金的信息披露.....	80
第十七部分 风险揭示.....	87
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	94
第十九部分 基金合同的内容摘要.....	96
第二十部分 托管协议的内容摘要.....	97
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....	98
第二十二部分 其他应披露事项.....	100
第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式.....	102
第二十四部分 备查文件.....	103
附件一：基金合同的内容摘要.....	104
附件二：托管协议的内容摘要.....	119

## 第一部分 绪言

《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及《安信中证复兴发展 100 主题指数型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、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本基金招募说明书中，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：指安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金
- 2、基金管理人：指安信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、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
- 9、《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
- 10、《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
- 11、《信息披露办法》：指《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
- 12、《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
- 13、《流动性风险管理规定》：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
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、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
- 16、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

- 17、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
- 18、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
- 19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 20、投资人：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人的合称
- 21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 23、销售机构：指安信基金管理有限责任公司以及符合《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代理协议，代为办理基金销售业务的机构
- 24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为安信基金管理有限责任公司或接受安信基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构
- 26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 28、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
- 29、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
- 30、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，最长不得超过三个月

- 31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 33、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 34、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 36、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
- 37、《业务规则》：指《安信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
- 38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 40、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
- 41、销售服务费：指从 C 类基金份额的基金资产中计提的，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
- 42、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额
- 43、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
- 44、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
- 45、定期定额投资计划：指投资人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人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



46、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%

47、元：指人民币元

48、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

49、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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、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

52、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

53、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

54、标的指数：中证复兴发展 100 主题指数及其未来可能发生的变更

55、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

56、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

57、摆动定价机制：指当本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。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

办公地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

法定代表人：刘入领

成立时间：2011 年 12 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可（2011）1895 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：50,625 万元人民币

存续期间：永续经营

联系人：陈静满

联系电话：0755-82509999

公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
五矿资本控股有限公司	39.84%
安信证券股份有限公司	33.95%
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	20.28%
中广核财务有限责任公司	5.93%

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

王连志先生，董事长，经济学硕士。历任长城证券有限公司投行部经理、中信证券股份有限公司投行部经理、第一证券有限责任公司副总经理、安信证券股份有限公司副总经理、安信基金管理有限责任公司总经理。现任安信证券股份有限公司董事、总经理、党委副书记。

刘入领先生，董事，经济学博士。历任国通证券股份有限公司（现招商证券股份有限公

司) 研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理；招商证券股份有限公司战略部副总经理（主持工作）、总裁办公室主任、理财客户部总经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事长。

任珠峰先生，董事，经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理，英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理，五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理、总经理等职务。现任中国五矿集团有限公司副总经理、党组成员，中国五矿股份有限公司董事、副总经理，五矿资本股份有限公司董事长、总经理、党委书记，五矿资本控股有限公司董事长、总经理，五矿国际信托有限公司董事长、党委书记，中国外贸金融租赁有限公司董事长，工银安盛人寿保险有限公司副董事长，绵阳市商业银行股份有限公司董事、党委书记。

王晓东先生，董事，经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员，日本五金矿产株式会社财务部科员，中国外贸金融租赁有限公司副总经理，中国五矿集团公司财务总部副总经理，五矿投资发展有限责任公司副总经理等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员，五矿资本控股有限公司副总经理、资本运营部总经理，五矿经易期货有限公司董事长、党委书记，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，绵阳市商业银行股份有限公司董事。

章卉女士，董事，理学硕士。历任安永华明会计师事务所高级审计员，广州华多网络科技有限公司财务经理，广州市百果园信息技术有限公司财务负责人。现任帕拉丁股权投资有限公司财务总监。

郭伟喜先生，董事，经济学学士。历任福云会计师事务所项目经理，上海中科合臣股份有限公司财务主管，厦门天地安保险代理有限公司财务总监，高能资本有限公司投资银行业务董事等职务。现任中广核财务有限公司投资银行部副总经理（主持工作）。

庞继英先生，独立董事，金融学博士，高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部，国家外汇管理局副处长、处长、副司长，中国外汇交易中心副总裁、总裁，中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员，中国再保险（集团）股份有限公司党委副书记、副董事长、国家开发银行股份有限公司董事。

魏华林先生，独立董事，1977 年毕业于武汉大学政治经济学专业、1979 年毕业于厦门大学政治经济学研究班。历任武汉大学经济系讲师，保险系副教授、副系主任、主任，保险经济研究所所长。现任武汉大学风险研究中心主任、教授、博士生导师，中国原保监会咨询委员会委员、中国金融学会常务理事暨学术委员会委员、中国保险学会副会长、湖北省政府文史研究馆馆员。

尹公辉先生，独立董事，法学硕士。历任四川建材工业学院辅导员、学办主任，中农信（香港）集团有限公司法务主管，广东信达律师事务所专职律师，广东华商律师事务所专职律师，广东百利孚律师事务所合伙人。现任广东信达律师事务所合伙人，深圳北鼎晶辉科技股份有限公司独立董事，深圳市律师协会公平交易委员会委员。

## 2、基金管理人监事会成员

刘国威先生，监事会主席，工商管理硕士。历任五矿集团财务公司资金部科长、香港企荣财务有限公司资金部高级经理、五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、五矿投资发展有限责任公司规划发展部总经理、五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员等职务。现任五矿资本股份有限公司副总经理、党委委员，五矿资本控股有限公司副总经理，工银安盛人寿保险有限公司监事会主席，中国外贸金融租赁有限公司董事，五矿证券有限公司董事，五矿国际信托有限公司董事，五矿经易期货有限公司董事。

余斌先生，监事，经济学学士。历任深圳鸿华实业股份有限公司财务审计经理、南方证券股份有限公司稽核部副总经理、中科证券托管组副组长。现任安信证券股份有限公司计划财务部总经理。

陈明女士，监事，会计学学士。历任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）广州分所审计经理。现任深圳市帕拉丁股权投资有限公司事业部副总经理。

范瑛女士，职工监事，工商管理硕士。历任深圳特发实业有限公司财务部主办会计，交通银行深圳分行国际业务部主办会计，融通基金管理有限公司登记清算部基金会计，大成基金管理有限公司基金运营部总监，现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼运营部总经理。

王卫峰先生，职工监事，工商管理硕士，注册会计师。历任吉林省国际信托公司财务人员，汉唐证券有限责任公司营业部财务经理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部

监察稽核主管，浦银安盛基金管理有限公司监察部负责人。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼监察稽核部总经理兼风险管理部总经理。

张再新先生，职工监事，经济学硕士。历任安信证券股份有限公司计划财务部会计，安信基金管理有限责任公司财务部会计、工会财务委员。现任安信基金管理有限责任公司运营部总经理助理、交易主管。

### 3、基金管理人高级管理人员

王连志先生，董事长，经济学硕士。简历同上。

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理，招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理，安信证券股份有限公司资产管理部副总经理、证券投资部副总经理，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金投资部总经理、东方基金管理有限责任公司副总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

孙晓奇先生，副总经理，经济学硕士。历任上海石化股份有限公司董事会秘书室高级经理，上海证券交易所交易运行部襄理、市场发展部高级经理、债券基金部执行经理，南方证券行政接管组成员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司督察长、副总经理兼安信乾盛财富管理（深圳）有限公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

李学明先生，副总经理，哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理，理财发展部高级经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理，安信基金筹备组成员；安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理。

廖维坤先生，副总经理兼首席信息官，理学学士。历任轻工业部南宁设计院电算站软件工程师，申银万国证券股份有限公司深圳营业部电脑主管，南方证券股份有限公司深圳管理总部电脑工程师、布吉营业部营业部副总经理、稽核总部高级经理、经纪业务总部高级经理，安信证券股份有限公司信息技术部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理兼首席信息官，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司监事。

乔江晖女士，督察长，文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、副处长，安信证券

股份有限公司安信基金筹备组成员，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

#### 4、本基金基金经理

龙川先生，统计学博士。历任 Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。2015 年 5 月 14 日至今，任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理；2016 年 10 月 12 日至今，任安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2017 年 7 月 3 日至 2019 年 3 月 4 日，任安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 6 日至 2019 年 5 月 6 日，任安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式基金基金经理；2018 年 6 月 21 日至今，任安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的基金经理；2018 年 9 月 3 日至今，任安信量化优选股票型发起式证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：

陈振宇先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

委员：

刘入领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

孙晓奇先生，副总经理，经济学硕士。简历同上。

钟光正先生，经济学硕士。历任广东发展银行总行资金部交易员，招商银行股份有限公司总行资金交易部交易员，长城基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼固定收益部总经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监。

陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理、权益投资部基金经理、权益投资部总经理、研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理助理兼研究总监。

龙川先生，统计学博士。简历同上。

占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有

限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理，安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司 FOF 投资部总经理。

杨凯玮先生，台湾大学土木工程学、新竹交通大学管理学双硕士。历任台湾国泰人寿保险股份有限公司研究员，台湾新光人寿保险股份有限公司投资组合高级专员，台湾中华开发工业银行股份有限公司自营交易员，台湾元大宝来证券投资信托股份有限公司基金经理，台湾宏泰人寿保险股份有限公司科长，华润元大基金管理有限公司固定收益部总经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。

张竞先生，金融学硕士。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理、安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。

陈鹏先生，工商管理硕士。历任联合证券有限责任公司行业研究员，鹏华基金管理有限公司基金经理，安信基金管理有限责任公司综合管理部首席招聘官。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、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、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、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、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

#### **四、基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

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

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或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）依照法律、行政法规有关规定和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、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；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### **五、基金经理承诺**

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



- 2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 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，不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

（1）健全性原则：内部控制覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，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，建立合理适用的内部控制程序，并适时调整 and 不断完善，维护内部控制制度的有效执行。

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位的职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作分离。

（4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应权责分明、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。

（6）防火墙原则：公司投资、交易、研究、评估、销售等业务环节，适当分离，以达到防范风险的目的，对因业务需要知悉内部信息的人员，制定严格的批准程序和监督措施。

### 2、内部控制的主要内容

#### （1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。公司在董事会下设立了合规与风险控制委员会，负责针对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究并制定相应的控制制度。

公司经理层牢固树立内部控制优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内部控制文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

公司构建有效的治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立合规、高效、健全、制衡的内部组织架构，建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

各职能部门是公司内部控制的具体实施单位。各部门在公司基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，加强对业务风险的控制。部门管理层定期对部门内风险进行评估，确定风险管理战略并实施，监控风险管理绩效，以不断改进风险管理能力。

## （2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险，包括定期和不定期的风险评估、开展新业务之前的风险评估以及违规、投诉、危机事件发生后的风险评估等。

## （3）控制活动

公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的内部控制防线。

公司建立科学的授权制度。授权控制是内部控制活动的基本要点，它贯穿于公司经营活动的始终。公司建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他受托资产要实行独立运作，单独核算。公司建立科学、严格的岗位分离制度，业务授权、业务执行、业务记录和业务监督严格分离，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位实行物理隔离。公司制定切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序。

## （4）信息与沟通

公司建立适当、有效的信息沟通机制和渠道，保证信息的真实性、准确性和完整性，实现公司内部信息的沟通和共享，促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织架构和授权制度，建立清晰的业务报告系统。

## （5）监督与内部稽核

内部控制的监督完善由公司合规与风险管理委员会、督察长和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。必要时，公司可聘请外部专家对内部控制进行检查和评价。

公司根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，对原有的内部控制定期进行全面检讨，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。

### 3、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）上述关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

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

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过

了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 440 只。

## 二、基金托管人的内部控制制度说明

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管

理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

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

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

##### （1）直销中心

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 25 层

办公地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 25 层

法定代表人：刘入领

电话：0755-82509820

传真：0755-82509920

联系人：江程

客户服务电话：4008-088-088

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

#### 2、其他销售机构

##### （1）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566/40066-95566

网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### （2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网站：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

##### （3）江苏张家港农村商业银行股份有限公司

住所：张家港市人民中路 66 号

法定代表人：季颖

客户服务电话：0512-96065

网站：[www.zrcbank.com](http://www.zrcbank.com)

（4）平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511-3

网站：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

（5）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：400-800-1001

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

（6）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客户服务电话：400-8888-666 / 95521

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

（7）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565

网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553

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

（9）中信证券股份有限公司



住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95558

网站：www.citics.com

（10）中信证券(山东)有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

网站：sd.citics.com

（11）东海证券股份有限公司

住所：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 5 楼

法定代表人：赵俊

客户服务电话：4008-888-588

网站：www.longone.com.cn

（12）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523 或 4008895523

网站：www.swhysc.com

（13）中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

客户服务电话：95329

网站：www.zszq.com

（14）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587/4008-888-108

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

（15）中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-9908-826

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

（16）中国国际金融股份有限公司

住所：中国北京建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：400-910-1166

网站：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

（17）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

客户服务电话：95532/4006-008-008

网站：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（18）东海期货有限责任公司

住所：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

客户服务电话：95531/400-8888588

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

（19）国信证券股份有限公司

住所：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

客户服务电话：95536

网站：<http://www.guosen.com.cn>

（20）东兴证券股份有限公司

住所：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

客户服务电话：4008888993

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

（21）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：95584/4008-888-818

网站：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

（22）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

网站：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（23）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

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

（24）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网站：[www.gjqz.com.cn](http://www.gjqz.com.cn)

（25）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-8888

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

（26）上海华信证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：陈灿辉

客户服务电话：400-820-5999

网站：[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

（27）宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话：4008-366-366

网站：[www.hx818.com](http://www.hx818.com)

（28）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客户服务电话：95597

网站：<http://www.htsc.com.cn/>

（29）平安证券股份有限公司

住所：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

客户服务电话：95511-8

网站：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

（30）申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：李琦

客户服务电话：400-800-0562

网站：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（31）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜味军

客户服务电话：4008323000

网站：<http://www.csc.com.cn>

（32）天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客户服务电话：95391/4008005000

网站：<http://www.tfzq.com>

（33）广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

网站：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

（34）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525

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

（35）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人：丁益

客户服务电话：4006666888

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

（36）开源证券股份有限公司

住所：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

客户服务电话：95325

网站：<http://www.kysec.cn/>

（37）西藏东方财富证券股份有限公司

住所：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

客户服务电话：95357

网站：<http://www.18.cn>

（38）联储证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

法定代表人：丁倩云

客户服务电话：400-620-6868

网站：[www.lczq.com](http://www.lczq.com)

（39）大同证券有限责任公司

住所：山西省太原市小店区长治路 111 号 12、13 层

法定代表人：董祥

客户服务电话：4007121212

网站：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

（40）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

客户服务电话：4000-766-123

网站：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（41）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-181-8188

网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（42）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

（43）和讯信息科技有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 E 座 18 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

（44）北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

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

（45）泰信财富基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦 C 座 12 层

法定代表人：张虎

客户服务电话：400-004-8821

网站：<http://www.hxlc.com>

（46）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：4008-773-772

网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（47）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（48）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008 室

法定代表人：赵荣春

客户服务电话：400-893-6885

网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

（49）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

（50）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

客户服务电话：400-930-0660

网站：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

（51）珠海盈米基金销售有限公司

住所：广州市珠海市琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

（52）北京晟视天下基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：400-818-8866

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

（53）北京中天嘉华基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区京顺路 5 号曙光大厦 C 座一层

法定代表人：洪少猛

客户服务电话：4006509972



网站：[www.5ilicai.cn](http://www.5ilicai.cn)

（54）浙江金观诚基金销售有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：蒋雪琦

客户服务电话：400-068-0058

网站：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

（55）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼（西环广场 T2）19 层 19C13

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

网站：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

（56）大泰金石基金销售有限公司

住所：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人：姚杨

客户服务电话：400-928-2266

网站：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

（57）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：董云巍

客户服务电话：400-088-8080

网站：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

（58）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：江卉

客户服务电话：400 098 8511

网站：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

（59）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：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

法定代表人：李昭琛

客户服务电话：010-62675369

网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

（60）上海基煜基金销售有限公司

住所：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

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

（61）上海万得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

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

（62）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

法定代表人：陶捷

客户服务电话：400-027-9899

网站：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

（63）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：马勇

客户服务电话：400-116-1188

网站：[8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

（64）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客户服务电话：95177

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

（65）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区梨园路 6 号物资控股大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：400-678-8887

网站：[www.zlfund.cn/www.jjmmw.com](http://www.zlfund.cn/www.jjmmw.com)

（66）北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客户服务电话：400-066-8586

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

（67）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

客户服务电话：400-001-1566

网站：<http://www.yilucaifu.com>

（68）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：400-061-8518

网站：<https://danjuanapp.com/>

（69）中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人：弭洪军

客户服务电话：400-876-5716

网站：<https://www.cmiwm.com/>

（70）万家财富基金销售（天津）有限公司

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

客户服务电话：010-59013895

网站：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

（71）通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 楼

法定代表人：沈丹义

客户服务电话：400-101-9301

网站：<https://www.tonghuafund.com>

（72）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

网站：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

（73）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

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

（74）深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

住所：深圳市福田区福强路 4001 号深圳市世纪工艺品文化市场 313 栋 E-403

法定代表人：李春瑜

客户服务电话：400-680-3928

网站：[www.simuwang.com](http://www.simuwang.com)

（75）嘉实财富管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4400-021-8850

网站：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

（76）北京创金启富基金销售有限公司

住所：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-1818 /010-66154828

网站：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

（77）上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客户服务电话：021-50810673

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

（78）天津市凤凰财富基金销售有限公司

住所：天津市和平区南京路 181 号世纪都会 1606-1607

法定代表人：王正宇

客户服务电话：4007-066-880

网站：<http://www.phoenix-capital.com.cn>

（79）奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客户服务电话：400-684-0500

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

（80）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

客户服务电话：400-819-9868

网站：<http://www.tdyhfund.com/>

（81）民商基金销售（上海）有限公司

住所：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

客户服务电话：021-50206003

网站：<http://www.msftec.com/>

（82）上海联泰基金销售有限公司

住所：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

网站：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

（83）上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客户服务电话：4006-433-389

网站：[www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

（84）华瑞保险销售有限公司

住所：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 楼 806

法定代表人：路昊

客户服务电话：4001-115-818

网站：[www.huaruisales.com](http://www.huaruisales.com)

（85）北京百度百盈基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：张旭阳

客户服务电话：95599-4

网站：[www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

（86）江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市鼓楼区中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

网站：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

## 二、登记机构

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

办公地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

法定代表人：刘入领

电话：0755-82509865

传真：0755-82560289

联系人：宋发根

## 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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

## 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）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：李妍明

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集申请于 2018 年 2 月 2 日经中国证监会（2018）247 号文注册。

本基金运作方式为契约型、定期开放式，存续期为不定期。

本基金募集期从 2018 年 5 月 7 日起至 2018 年 6 月 15 日止，有效份额为 458,147,902.60 份基金份额，利息结转的基金份额为 253,927.00 份基金份额，两项合计 458,401,829.60 份基金份额。有效认购户数为 5136 户。



## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2018 年 6 月 21 日正式生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，并根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算，而无须召开基金份额持有人大会，同时向中国证监会报告；连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人但未出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的，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。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构（包括直销机构和其他销售机构）进行，具体的销售网点名单参见本招募说明书“第五部分 相关服务机构”部分相关内容及基金份额发售公告或其他公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。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。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

### 二、申购、赎回开放日及业务办理时间

#### 1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、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介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2018 年 6 月 28 日开放日常申购、赎回。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在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。投资人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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

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

投资人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

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请成立；登  
记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成立。

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。投资人赎  
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。遇证券、期货交易所  
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时，赎回款项顺延至前述影响因素消除的下一个  
工作日划出。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。

#### 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，投资人应在 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。

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，投资人应及时查询。若申购不成功或无效，则申购款项退还给投资人。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、通过本基金除基金管理人以外的其他销售机构进行申购，首次申购最低金额为人民币 10 元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 10 元（含申购费）；各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2、通过基金管理人的直销柜台进行申购，单个基金账户单笔首次申购最低金额为人民币 50,000 元（含申购费），追加申购最低金额为单笔人民币 10,000 元（含申购费）。

3、通过基金管理人网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为人民币 10 元（含申购费），追加申购最低金额为单笔人民币 10 元（含申购费），网上直销单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

4、投资人将持有的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

5、基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，每笔赎回申请不得低于 5 份基金份额。若基金份额持有人某笔交易类业务（如赎回、基金转换、转托管等）导致在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额少于 5 份时，余额部分基金份额必须全部一同赎回。

6、本基金对单个投资人的累计申购金额不设上限，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

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

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。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、申购与赎回的登记

投资人 T 日申购基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记结算手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

投资人 T 日赎回基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定，在指定媒介公告。

## 七、申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

本基金 A 类基金份额在投资人申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费。

本基金 A 类基金份额对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

A 类基金份额的申购费率结构表

申购金额 M（含申购费用）	申购费率（%）
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、登记和销售。

### 2、赎回费率

基金的赎回费率表

份额类别	持有基金份额期限（T）	赎回费率（%）
A 类赎回费率	T < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ T < 30 天	0.30%
	30 天 ≤ T < 180 天	0.10%
	T ≥ 180 天	0
C 类赎回费	T < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ T < 30 天	0.10%
	T ≥ 30 天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，对 A、C 类份额，对持续持有期少于 7 天的投资人收取的赎回费，100%归入基金资产；对持续持有期超过 7 天（含 7 天）的投资人收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产，其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人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》的有关规定在指定的媒介上公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的自律规则，具体见基金管理人届时的相关公告。

5、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申购费率和基金赎回费率，并进行公告。

## 八、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算方式：

（1）若投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购费用适用比例费率：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

申购费用适用固定金额：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假定 T 日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0520 元，某投资人本次申购本基金 A 类基金份额 25 万元，对应的本次申购费率为 1.20%，该投资人可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=250,000/（1+1.20%）=247,035.57 元

申购费用=250,000-247,035.57=2,964.43 元

申购份额=247,035.57/1.0520=234,824.69 份

即：投资人投资 25 万元申购 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0520 元，可得到 234,824.69 份 A 类基金份额。

（2）若投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资 100,000 元申购 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 C 类基金份额为：

申购份额=100,000/1.0000=100,000.00 份

即：投资人投资 100,000 元申购 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 C 类基金份额 100,000.00 份。

2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-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：某投资者赎回本基金 A 类基金份额 2 万份，持有时间为 120 天，对应的赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2100 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=20,000×1.210=24,200.00 元

赎回费用=24,200.00×0.10%=24.20 元

净赎回金额=24,200.00-24.20=24,175.80 元

即：投资者赎回本基金 2 万份 A 类基金份额，持有时间为 120 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2100 元，则其可得到的赎回金额为 24,175.80 元。

例：某投资者赎回本基金 C 类基金份额 1 万份，持有时间为 5 天，对应的赎回费率为

1.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0680 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0680=10,680.00 元

赎回费用=10,680.00×1.50%=160.20 元

净赎回金额=10,680.00-160.20=10,519.80 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 5 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0680 元，则其可得到的赎回金额为 10,519.80 元。

3、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的份额净值的计算，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 日各类基金份额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。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

#### 九、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能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，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
- 7、某笔或者某些申购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。
- 8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当



采取暂停接受基金申购申请的措施。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、8、9 项情形之一且基金管理人决定暂停申购情形时，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。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十、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人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人的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，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，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

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，应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应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，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。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。

## 十一、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人的全部赎回申请时，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人的赎回申请有困难或认为因支付投资人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。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人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该类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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(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。

(4) 本基金发生巨额赎回时，对于在开放日内单个基金份额持有人超过基金总份额 50% 以上的赎回申请情形的，除未超过基金总份额 50% 以内的赎回申请按上述规定办理赎回申

请外，基金管理人应当对单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上部分的赎回申请延期办理。对于未能赎回部分，投资人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，延期的赎回申请与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一个开放日的该类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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 十二、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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并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 个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，基金管理人最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

## 十三、基金转换

本基金已于 2018 年 6 月 28 日开通转换业务，具体实施办法详见相关公告。

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。

#### 十四、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。

#### 十五、基金的非交易过户

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

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

#### 十六、基金的转托管

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

#### 十七、定期定额投资计划

本基金已于 2018 年 6 月 28 日开通定期定额投资业务，具体实施办法详见相关公告。

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人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。

#### 十八、基金份额的冻结、解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认

可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规另有规定的除外。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证复兴发展 100 主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

### 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，以中证复兴发展 100 主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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)。

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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

### 三、投资策略

#### 1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资，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。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发

生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

#### （1）组合构建策略

本基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1) 确定目标组合：本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

2) 确定建仓策略：本基金管理人根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

3) 逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

#### （2）组合管理策略

##### 1) 定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

##### 2) 不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司的公告，进行相应调整；

②根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

③若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

#### 2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 3、债券投资策略

本基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率

水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 4、国债期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

#### 5、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，在此基础上谨慎进行权证投资。本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在形成的风险对冲机会，在充分论证和模型分析的基础上谨慎构建套利投资组合，获取相对稳定的投资收益。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

### 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）本基金投资于中证复兴发展 100 主题指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结



算备付金、存出保证金、应收申购款；

- (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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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；
- (11) 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；
- (12) 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，债券回购到期后不展期；
- (13) 本基金参与股指期货或国债期货的，在任何交易日日终，持有的买入国债期货及股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- (14) 本基金参与股指期货交易：
  - 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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票

总市值的 20%；

3) 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；

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

（15）本基金参与国债期货交易：

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

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

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

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

（16）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（17）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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（19）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）、（10）、（17）、（18）条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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。

如果法律法规对基金合同约定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。

## 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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，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。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

## 五、标的指数与业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金的标的指数是中证复兴发展 100 主题指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指

数。

由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

## 2、业绩比较基准

中证复兴发展 100 主题指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

由于本基金投资标的指数为中证复兴发展 100 主题指数，且每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证复兴发展 100 主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，调整业绩比较基准应取得基金托管人同意并按照监管部门要求履行适当程序，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告，无需召开持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。产品风险等级以各销售机构的评级结果为准。

## 七、未来条件许可情况下的基金模式转型

若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并提前公告。ETF 联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的

指数为目的的指数化产品。

## 八、基金投资组合报告

本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。

本基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日，来源于《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》。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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	60,143,276.09	90.20
	其中：股票	60,143,276.09	90.20
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	6,222,071.88	9.33
8	其他资产	311,639.81	0.47
9	合计	66,676,987.78	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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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	3,605,335.00	5.62
C	制造业	36,686,034.54	57.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,968.00	0.09
E	建筑业	3,583,699.00	5.59
F	批发和零售业	3,055,927.31	4.77
G	交通运输、仓储和邮政业	1,456,772.00	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,730,463.00	4.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,864,150.96	9.15
L	租赁和商务服务业	839,469.38	1.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	565,159.00	0.88
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	1,281,518.00	2.00

	业		
S	综合	-	-
	合计	59,727,496.19	93.15

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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	248,533.96	0.39
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	32,902.94	0.05
J	金融业	134,343.00	0.21
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	415,779.90	0.65

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	000002	万科A	100,540	3,088,588.80	4.82
2	002422	科伦药业	81,000	2,344,950.00	3.66
3	600104	上汽集团	84,100	2,192,487.00	3.42
4	600332	白云山	52,600	2,051,400.00	3.20
5	600585	海螺水泥	45,800	1,748,644.00	2.73
6	600309	万华化学	37,166	1,692,167.98	2.64
7	600028	中国石化	294,000	1,687,560.00	2.63
8	600031	三一重工	127,504	1,629,501.12	2.54
9	002001	新和成	83,003	1,533,895.44	2.39
10	601857	中国石油	191,700	1,456,920.00	2.27

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.21



2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.13
3	002950	奥美医疗	1,854	63,110.16	0.10
4	002951	金时科技	1,675	57,653.50	0.09
5	300766	每日互动	1,193	32,902.94	0.05

#### 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。

#### 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进

行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

**11、投资组合报告附注**

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	23,139.20
2	应收证券清算款	285,749.97
3	应收股利	-
4	应收利息	1,536.86
5	应收申购款	1,213.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,639.81

（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债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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的情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 第十部分 基金的业绩

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

本基金合同生效日为 2018 年 6 月 21 日，基金合同生效以来（截至 2019 年 3 月 31 日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

中证复兴 100 指数 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.6.21-2018.12.31	-12.94%	1.31%	-18.82%	1.51%	5.88%	-0.20%
2019.1.1-2019.3.31	24.44%	1.41%	24.50%	1.44%	-0.06%	-0.03%

中证复兴 100 指数 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.6.21-2018.12.31	-13.10%	1.31%	-18.82%	1.51%	5.72%	-0.20%
2019.1.1-2019.3.31	24.37%	1.41%	24.50%	1.44%	-0.13%	-0.03%

本基金基金合同生效日为 2018 年 6 月 21 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。表中所列基金及业绩比较基准的相关数值为 2018 年 6 月 21 日至 2019 年 3 月 31 日间各自的实际数值。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十二部分 基金资产的估值

### 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、权证、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、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）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），采用估值技术确定公允价值，可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）交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

交易所上市实行全价交易的债券（可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，可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；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、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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。

6、股指期货合约，一般以估值日结算价估值；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，以最近交易日结算价估值。

7、国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

#### 四、估值程序

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

基金管理人于每个工作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、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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，由基金管理人对外公布。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后四位以内(含第四位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，



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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人；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一致的，基金管理人应当暂停估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。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各类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、由于证券、期货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。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，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；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；

同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准。

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、

分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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

### **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金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。

## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、标的指数许可使用费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### 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按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，再由基金管理人支付给基金销售机构。

### 4、标的指数许可使用费

本基金基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

自基金合同生效之日起，标的指数许可使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月、4 月、7 月、10 月从基金资产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

上述“一、基金费用的种类”中第 5-11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并经基金份额持有人大会审议通过后，可调整基金管理费率、基金托管费率或提高基金销售服务费率。

调低本基金 C 类基金份额的销售服务费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

### 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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。



## 第十六部分 基金的信息披露

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

### 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：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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其网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；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。

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。

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各自网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金资产净值、基金份额净值

《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各类基金份额净值。

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各类基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和

各类基金份额累计净值登载在指定媒介上。

#### （五）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 A 类基金份额的申购费率及 A 类和 C 类基金份额的赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）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介上。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介上。

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介上。

《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或书面报告方式。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，为保障其他投资者的利益，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有风险。

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。

#### （七）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百分之五十；
- 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者仲裁；
- 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、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 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、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、调整基金份额类别；
- 27、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；
- 28、基金管理人采用摆动定价机制；
- 29、中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）基金投资股指期货的信息披露

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

#### （十一）基金投资国债期货的信息披露

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

#### （十二）投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十三）投资流通受限证券信息披露

本基金投资非公开发行股票，基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会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。

（十四）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介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。

## 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。

## 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

1、不可抗力；

- 2、出现基金合同约定的暂停估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

投资基金面临的风险主要有：

#### 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而产生风险，主要包括：

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

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

（3）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的波动，并影响着企业的融资成本和利润。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

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

（6）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响。

（7）信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。此外，回购交易中由于融资方（正回购方）违约到期无法及时支付回购利息，也将会对基金资产造成损失。

#### 2、管理风险



基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

（1）决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

（2）操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

（3）技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

#### 4、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

#### 5、合规性风险

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

#### 6、本基金的特有风险

##### （1）与标的指数偏离风险

本基金的运作目标是紧密跟踪中证复兴发展 100 主题指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。但由于以下原因可能造成两者间偏离度增加的风险：

1) 标的指数成份股的调整以及指数计算方法的变更；

2) 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；

3) 当基金投资组合中按基准权重投资的资产类别或单个证券超过规定比例限制时进行的被动性卖出调整；因债券投资比例限制，在债券或股票资产净值变动较大时造成的被动仓位调整；

4) 基金持有股票/债券的增发、分红送配造成基金组合的比例变动；

5) 标的指数成份股中停牌、摘牌等突发因素；

- 6) 基金买卖股票时产生的交易冲击成本;
- 7) 申购赎回资金变动带来的跟踪误差增加;
- 8) 基金资产中需扣除管理费用和托管费用;
- 9) 标的指数选择所带来的系统性风险。

#### (2) 基金价格变动风险

本基金为指数型基金,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%,因此,本基金因股票资产投资比例较大,当所追踪之标的指数因市场原因出现大幅下跌时,会造成基金份额净值的相应下跌,产生跌破基金发行价的风险。

#### (3) 股指期货特有的风险

**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。

**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。

**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,换成其他月份股指期货合约,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。

**期货盯视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。

**到期日风险:** 股指期货合约到期时,本基金的账户如仍持有未平仓合约,交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割,因此无法继续持有到期合约,具有到期日风险。

**对手方风险:** 资产管理人运用基金资产投资于股指期货时,会尽力选择资信状态优良、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。

**连带风险:** 为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足,或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行

平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

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、中金所交易规则的修改、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。

#### （4）资产支持证券投资风险

资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。信用风险是基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失；利率风险是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险；流动性风险是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险；提前偿付风险是债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

#### （5）国债期货的投资风险

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

### 7、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也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## 8、税负增加风险

财政部、国家税务总局财政[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于基金合同中基金管理人的管理费中不包括产品运营过程中发生的税款，本基金运营过程中需要缴纳增值税应税的，将由基金份额持有人承担并从基金资产中支付，按照税务机关的规定以基金管理人为增值税纳税人履行纳税义务，因此可能增加基金份额持有人的投资税费成本。

## 9、其他风险

（1）随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

（7）其他意外导致的风险。

## 二、本基金的流动性风险管理

### （一）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排参见本招募说明书第八部分的约定。

### （二）流动性风险评估

流动性风险是指基金投资流动性受限资产时，因投资者赎回导致基金规模下降而使基金资产的流动性出现明显降低的风险。

本基金主要投资于证券市场、期货市场，在投资运作过程中，为有效应对和处理本基金可能面临的流动性风险，防范由于流动性不足导致的风险事件或损失，基金管理人将充分考虑投资股票、债券等证券品种的流动性，以及投资组合整体的流动性，降低基金资产的流动

性风险。

### （三）巨额赎回下的流动性风险管理措施

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。

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人的全部赎回申请时，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人的赎回申请有困难或认为因支付投资人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。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人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该类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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（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。

（4）本基金发生巨额赎回时，对于在开放日内单个基金份额持有人超过基金总份额 50% 以上的赎回申请情形的，除未超过基金总份额 50% 以内的赎回申请按上述规定办理赎回申请外，基金管理人应当对单个基金份额持有人超过基金总份额 50% 以上部分的赎回申请延期办理。对于未能赎回部分，投资人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，延期的赎回申请与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一个开放日的该类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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动

延期赎回处理。

（四）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序

基金管理人经与基金托管人协商一致，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。本基金的流动性风险管理工具包括但不限于：

- 1、延期办理巨额赎回申请；
- 2、暂停接受赎回申请；
- 3、延缓支付赎回款项；
- 4、收取短期赎回费；
- 5、暂停基金估值；
- 6、摆动定价；
- 7、中国证监会认定的其他措施。

具体处理程序详见基金合同相关约定，以上流动性管理工具将使投资者无法及时全部或部分赎回基金份额，无法及时全部或部分获得赎回款项等。

### 三、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金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，本基金还通过其他基金销售机构销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经基金份额持有人大会表决通过生效后方可执行，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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财产；

- (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。



## 第十九部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 第二十部分 托管协议的内容摘要

托管协议的内容摘要见附件二。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

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

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、每次交易结束后，投资者应在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过电话、网上服务手段查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄送交易确认单。

2、每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（[www.essencefund.com](http://www.essencefund.com)）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 [service@essencefund.com](mailto:service@essencefund.com)；也可直接拨打全国统一客服热线 4008-088-088（免长途话费）订阅。

### 二、定期投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资者可以定期申购基金份额，具体实施时间、方法另行公告。

### 三、网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

1、自助开户交易：投资者持有建设银行、农业银行、招商银行等银行的借记卡可以在基金管理人网站上自助开户并进行网上交易业务。

2、查询服务：投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改联络信息等基本资料。

3、信息咨询服务：投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

4、在线客服：投资者可以点击基金管理人网站首页“在线客服”，与客服代表进行在线咨询互动。

#### 四、短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

#### 五、电子邮件服务

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

#### 六、信息订阅服务

投资者可以通过基金管理人网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

#### 七、客户服务中心电话服务

投资者拨打基金管理人全国统一客服热线：4008-088-088（免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：客服中心自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息。

2、人工电话服务：客服代表可以为投资者提供业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制等服务。

3、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

服务联系方式：

基金管理人的互联网地址及电子信箱

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

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

八、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。

## 第二十二部分 其他应披露事项

序号	标题	日期
1	安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	2019 年 1 月 19 日
2	安信基金管理有限责任公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司和北京钱景基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	2019 年 1 月 30 日
3	安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第 1 号）	2019 年 2 月 1 日
4	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	2019 年 2 月 28 日
5	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持长春高新（000661）估值调整的公告	2019 年 3 月 6 日
6	安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	2019 年 3 月 29 日
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持格力电器（000651）估值调整的公告	2019 年 4 月 2 日
8	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	2019 年 4 月 3 日
9	安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	2019 年 4 月 22 日
10	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	2019 年 5 月 13 日
11	关于安信平稳增长混合型发起式证券投资基金 C 类份额等基金新增开源证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	2019 年 5 月 15 日
12	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代	2019 年 5 月 20 日

	理服务机构的公告	
13	关于安信基金管理有限责任公司新增开放式基金销售代理服务机构的公告	2019 年 5 月 22 日
14	安信基金管理有限责任公司高级管理人员（副总经理）变更公告	2019 年 6 月 1 日

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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

## 第二十四部分 备查文件

- （一）中国证监会准予安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金基金合同》
- （三）《安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请募集注册安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金之法律意见书
- （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

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

安信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 5 日



## 附件一：基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利和义务

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回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。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金投资价值，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）基金管理人的权利和义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (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；
- (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、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

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

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

- （14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
  - （15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
  - （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
  - （17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
  - （18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
  - （19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
  - （20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
  - （21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
  - （22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
  - （23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
  - （24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；
  - （25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
  - （26）建立并保存基金份额持有人名册；
  - （27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
- （三）基金托管人的权利和义务
- 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，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、基金份额申购、赎回价格；

- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 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。

### （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》（基金合同另有约定的除外）；

- (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，法律法规、《基金合同》和中国证监会另有规定除外；
- (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（根据法律法规的要求调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外）；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 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) 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、在不违反法律法规规定和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低销售服务费和其他应由基金承担的费用；
- (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》规定的范围内调整本基金的申购费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式、调低赎回费率、调整基金份额类别；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (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以外的其他情

形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

## （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，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 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）；

若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额低于上述规定比例的，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 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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，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。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

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

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

#### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%

以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作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。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，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，基金管理人经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、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经基金份额持有人大会表决通过生效后方可执行，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组成员：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财产；
- （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六个月。

### （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。

### 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则任何一方有权将争议提交位于北京市的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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

《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。

## 附件二：托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：安信基金管理有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

邮政编码：518026

法定代表人：刘入领

成立日期：2011 年 12 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2011〕1895 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.0625 亿元人民币

存续期间：永续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营



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

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证复兴发展 100 主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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)。

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。

本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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易

保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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

（1）本基金投资于中证复兴发展 100 主题指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

（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、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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）本基金管理人管理的、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%；

（10）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；

（11）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；

（12）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，债券回购到期后不展期；

（13）本基金参与股指期货或国债期货的，在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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；

（14）本基金参与股指期货交易：

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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

3）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；

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

（15）本基金参与国债期货交易：

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

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

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

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

（16）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（17）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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

除上述第（2）、（10）、（17）条外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定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。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第十一项基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人有权向中国证监会报告。

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的原则，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。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行

间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

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

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

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

2、流通受限证券与上文所述流通性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的

可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

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

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

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

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

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

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

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

期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

### 三、基金管理人有关基金托管人的业务核查

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

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

（三）基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知

基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

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

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，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，基金托管人应提供充分协助。

##### （三）基金资金账户的开立和管理



1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

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

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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

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

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

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

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

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银

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

#### （六）其他账户的开立和管理

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

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值的计算及复核程序

### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定

公告。

## 2、复核程序

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

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

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

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

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

## 七、争议解决方式

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

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更、终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止的情形

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