

---

中邮中证 500 指数增强型证券投资基金  
招募说明书

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一九年十二月

---

## 重要提示

中邮中证 500 指数增强型证券投资基金由中邮上证 380 指数增强型证券投资基金变更而来。中邮上证 380 指数增强型证券投资基金自 2019 年 11 月 11 日至 2019 年 12 月 10 日，以通讯方式召开的基金份额持有人大会，大会审议通过了《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括对中邮上证 380 指数增强型证券投资基金变更投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、收益分配原则、费率水平及修订基金合同等，并同意将转型后基金更名为“中邮中证 500 指数增强型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自决议通过之日起生效。

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。

本基金的目标客户不包括特定的机构投资者。

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。

投资有风险，投资人投资于本基金前应认真阅读本招募说明书。全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。

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

---

# 目 录

一、前 言.....	1
二、释 义.....	2
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	21
六、基金的历史沿革与存续.....	60
七、基金份额的申购与赎回.....	61
八、基金的投资.....	70
九、基金的财产.....	80
十、基金财产的估值.....	81
十一、基金的收益与分配.....	86
十二、基金的费用与税收.....	87
十三、基金的会计和审计.....	90
十四、基金的信息披露.....	91
十五、风险揭示.....	97
十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	103
十七、基金合同内容摘要.....	106
十八、基金托管协议的内容摘要.....	128
十九、对基金份额持有人的服务.....	138
二十、招募说明书存放及查阅方式.....	141
二十一、备查文件.....	142

---

## 一、前 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》编写。

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

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

---

## 二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：指中邮中证 500 指数增强型证券投资基金，本基金由中邮上证 380 指数型增强型证券投资基金变更注册而来；
- 基金合同或本基金合同：指《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：指《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 基金产品资料概要：指《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 托管协议：指《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《信息披露办法》:	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订;
《流动性风险管理规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订;
元:	指人民币元;
基金管理人:	指中邮创业基金管理股份有限公司;
基金托管人:	指中国银行股份有限公司;
注册登记业务:	指本基金登记、存管、清算和交收业务, 具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
注册登记机构:	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中邮创业基金管理股份有限公司或接受中邮创业基金管理股份有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构;
投资者:	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者;
个人投资者:	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人;
机构投资者:	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织;
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;
基金份额持有人大会:	指按照本基金合同第七部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议;
基金募集期:	指基金合同和招募说明书中载明, 并经中国证监会核准的基金份额募集期限, 自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月;

---

基金合同生效日:	指募集结束, 基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的, 基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后, 中国证监会的书面确认之日;
存续期:	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限;
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
A 类基金份额:	指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售服务费的基金份额;
C 类基金份额:	指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额
申购:	指在本基金合同生效后的存续期间, 投资者申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指在本基金合同生效后的存续期间, 基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为;
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%;
基金转换:	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件, 申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为;
转托管:	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为;
指令:	指基金管理人在运用基金财产进行投资时, 向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件, 取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托, 代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构;

---

销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;
基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点;
指定媒介:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介;
基金账户:	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户;
交易账户:	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户;
开放日:	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日;
T 日:	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日。
T+n 日:	指 T 日后(不包括 T 日)第 n 个工作日, n 指自然数;
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、银行存款利息以及其他合法收入;
基金资产总值:	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值;
基金财产估值:	指计算、评估基金财产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
不可抗力:	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素,包括



---

	<p>但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。</p>
流动性受限资产	<p>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</p>
摆动定价机制	<p>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。</p>

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

名称：中邮创业基金管理股份有限公司

成立时间：2006年5月8日

住所：北京市东城区和平里中街乙16号

办公地址：北京市东城区和平里中街乙16号

法定代表人：曹均

注册资本：3.041亿元人民币

股权结构：

股东名称	出资比例
首创证券有限责任公司	46.37%
中国邮政集团公司	28.61%
三井住友银行股份有限公司	23.67%
华创证券有限责任公司	0.60%
财富证券有限责任公司	0.31%
天风证券股份有限公司	0.23%
国金证券股份有限公司	0.07%
恒泰证券股份有限公司	0.07%
华金证券股份有限公司	0.07%
总计	100%

公司客服电话：400-880-1618

公司联系电话：010-82295160

联系人：李晓蕾

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

曹均先生，中共党员，经济学硕士研究生。曾任职河北省财政厅主任科员、中央财政金融学院教师、北京京广中心有限公司中方财务总监、日本大和证券北京代表处代表、北京利达行房地产集团副总经理、

---

北京永事达投资顾问有限责任公司总经理、首创证券经纪有限责任公司财务总监、首创证券有限责任公司副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司董事长。

孔军先生，大学本科学历，经济学学士，高级经济师。曾任中国人民大学财政系助教、中国对外经济贸易信托投资公司业务经理、中国光大集团部门经理、长城证券有限责任公司北京总部总经理、首创证券有限责任公司总经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司资产管理事业部负责人、首誉资产管理有限公司总经理、中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司总经理。

王洪亮先生，硕士研究生，曾任深圳外汇经纪中心交易部外汇交易员、中国新技术创业投资公司深圳证券管理部资金部经理、首创证券有限责任公司深圳吉华路证券营业部总经理、首创证券有限责任公司经纪业务总部总经理（后为经纪业务事业部总裁）、首创证券有限责任公司总经理助理、首创证券有限责任公司深圳分公司总经理、首创证券有限责任公司安徽分公司总经理。现任首创证券有限责任公司副总经理兼资产管理事业部总裁、首正德盛资本管理有限公司董事长、北京望京投资基金管理有限公司董事长。

张志名先生，硕士研究生，曾任首创证券有限责任公司固定收益总部投资经理、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理助理、首创证券有限责任公司固定收益总部副总经理、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理、首创证券有限责任公司债券融资总部总经理、首创证券有限责任公司总经理助理。现任首创证券有限责任公司副总经理、固定收益事业部总裁、证券投资总部总经理，首创京都期货有限公司董事，首正泽富创新投资（北京）有限公司董事。

马敏先生，中共党员，本科毕业，会计师。曾任职广西壮族自治区财政厅商财处干部、广西壮族自治区财政厅商财处副主任科员、广西壮族自治区财政厅财政厅商财处主任科员、财政部商贸司内贸二处主任科员、财政部经贸司粮食处主任科员、财政部经建司粮食处副处长、财政部经建司粮食处处长、财政部经建司交通处处长、财政部经建司粮食处处长、财政部经建司粮食处调研员、中国邮政集团公司财务部干部、中国邮政集团公司财务部总经理助理（三级正）、中国邮政集团公司财务部副总经理。现任中国邮政集团公司财务部资深经理。

村田拓也先生，曾就职于樱花银行（现三井住友银行）。入行后在神户营业第一部、投资银行 DC 资金证券管理部等、后派赴投资银行营业部（香港）任亚洲营业部（香港）副总裁、亚洲营业部（上海）副总裁，三井住友银行（中国）有限公司金融解决方案部副总裁。后历任日本银座法人营业第二部副总裁、国际统括部高级副总裁、国际法人营业部高级副总裁，亚洲课课长。现任三井住友银行（中国）股份有限公司本店营业第二部副部长。

孙振华先生，中共党员，法律硕士。曾任职北京市门头沟区人民法院科员，中冶海外工程有限公司秘书，中冶海外香港有限公司先后任总经理助理、副总经理、董事副总经理，北京观韬中茂律师事务所合伙人律师。现任天津允公（北京）律师事务所合伙人律师。

---

李燕女士，教授，博士生导师。曾任职中央财政金融学院财政系（现为中央财经大学）。现任中央财经大学财税学院教授，博士生导师，人大预算监督研究中心主任、政府预算管理研究所所长，中国财政学会理事、中国财税法学研究会理事、全国政府预算研究会副会长，青岛港国际股份有限公司、东华软件股份有限公司两家上市公司独立董事，以及青岛啤酒股份有限公司外部监事。

李铁先生，工商管理硕士。曾任职花旗银行全球公司和投资银行部高级经理、德国 HVB 资本集团投资基金合伙人、中华水电公司总裁及创始人。现任哥伦比亚中国资本集团董事长及创始人、深圳市前海先行投资公司董事长及创始人。

## 2、监事会成员

赵永祥先生，监事长，中共党员，硕士研究生，高级经济师。曾任河北省邮电管理局计财处干部，河北省邮电管理局经营财务处干部，石家庄市邮政局副局长，国家邮政局计财部副处长，石家庄市邮政局党委副书记、副局长（主持工作）、石家庄市邮政局局长、党委书记，河北省邮政局助理巡视员，中国邮政集团公司财务部副总经理、河北省邮政公司助理巡视员，中国邮政集团公司财务部副总经理。现任中国邮政集团公司审计局局长。

周桂岩先生，硕士研究生，曾任中国信息信托投资公司证券部经理助理兼北京营业部总经理、北京凯源律师事务所律师、航空信托投资有限责任公司证券部总经理、首创证券有限责任公司资产管理总部总经理、首创证券有限责任公司合规部总经理、首创证券有限责任公司合规总监、首席风险官、总法律顾问。现任首创证券有限责任公司纪委书记。

段木女士，1979 年 1 月出生，中共党员，博士研究生。曾任民政部管理干部学院社会福利教研室主任、中邮创业基金管理股份有限公司人力资源部副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司人力资源部总经理。

李莹女士，1982 年 5 月出生，中共党员，硕士研究生。先后就职于北京市教育委员会办公室、中共北京市委办公厅会议处、首誉资产管理有限公司、中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部。现任中邮创业基金管理股份有限公司总裁办公室总经理。

吴科先生，1979 年 9 月出生，大学本科学历。曾任中青在线任人才频道经理、CCTV《12 演播室》编导、北京远景东方影视传播有限公司任编导、主编。现任中邮创业基金管理股份有限公司公共事务部副总经理。

## 3. 公司高级管理人员

曹均先生，中共党员，经济学硕士研究生。曾任职河北省财政厅主任科员、中央财政金融学院教师、北京京广中心有限公司中方财务总监、日本大和证券北京代表处代表、北京利达行房地产集团副总经理、北京永事达投资顾问有限责任公司总经理、首创证券经纪有限责任公司财务总监首创证券有限责任公司副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司董事长。

---

孔军先生，大学本科学历，经济学学士，高级经济师。曾任中国人民大学财政系助教、中国对外经济贸易信托投资公司业务经理、中国光大集团部门经理、长城证券有限责任公司北京总部总经理、首创证券有限责任公司总经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司资产管理事业部负责人、首誉资产管理有限公司总经理、中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司总经理。

张啸川先生，中共党员，经济学博士。曾任中国证监会市场监管部结算监管处干部、中国证监会股权分置改革领导小组办公室主任科员、中国证监会市场监管部市场监控处副处长、中国证监会市场监管部综合处副处长、中国证监会市场监管部交易监管处处长、博时基金管理有限公司高级顾问兼北京分公司总经理、博时资本管理有限公司董事、宝盈基金管理有限公司总经理、董事、党工委书记。现任中邮创业基金管理股份有限公司常务副总经理。

唐亚明先生，本科，经济学学士。曾任职于联合证券赛格科技园营业部、深圳赛格财务公司、中信实业银行、首创证券有限责任公司、中邮创业基金管理有限公司、首誉光控资产管理有限公司。现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。

朱宗树先生，工商管理硕士，高级经济师。曾任重庆开县团委副书记、书记，重庆开县东华镇副书记、中国平安保险重庆分公司人事行政部经理、办公室主任，国家邮政储汇局综合处处长、中法人寿保险副总经理、中国邮政集团公司代理业务部副总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。

郭建华先生，工学硕士。曾任长城证券有限公司研发中心总经理助理、长城证券有限公司海口营业部总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司督察长。

杨旭鹏先生，工程硕士。曾任北京中启计算机公司总工程师、中邮创业基金管理有限公司信息技术部总经理、信息技术总监、泰康资产管理有限公司互联网金融执行总监、文明互鉴文化传播（北京）有限公司总经理、中邮创业基金管理股份有限公司信息技术部总经理。现担任中邮创业基金管理股份有限公司首席信息官。

#### 4、本基金基金经理

俞科进先生：经济学硕士。曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、量化投资部员工、量化投资部副总经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。现任中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

王喆先生：经济学硕士。曾任工商银行北京分行海淀西区支行个金部职员、工商银行总行资产管理部投资管理岗、中邮创业基金管理股份有限公司证券投资基金研究分析员。现任中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

---

## 5、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会分为权益投资决策委员会和固定收益投资决策委员会。

权益投资决策委员会成员包括：

主任委员：

孔军先生，见公司高级管理人员介绍。

执行委员：

郑玲女士：金融硕士。曾任航天科技财务有限责任公司投资部投资经理、中邮创业基金管理股份有限公司投资部员工、中邮多策略灵活配置混合型投资基金基金经理助理、专户理财事业部投资经理及总经理助理。现任中邮创业基金管理股份有限公司权益投资部总经理、研究部总经理。

委员：

陈梁先生：经济学硕士。曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司权益投资部副总经理、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金基金经理。

聂璐女士：文学硕士。曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、首誉光控资产管理有限公司投资经理、中邮核心主题混合型证券投资基金基金经理助理、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司投资经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

刘田先生：经济学硕士。曾任中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理。现担任中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

杨欢先生：经济学硕士。曾任中国银河证券股份有限公司投资研究总部分析师、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。现任中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金基金经理。

纪云飞先生：工学博士。曾任首创证券有限责任公司证券投资部总经理助理、新三板做市负责人、中

---

邮核心优选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心优选混合型证券投资基金基金经理、中邮安泰双核混合型证券投资基金基金经理。现任中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理。

固定收益投资决策委员会成员包括：

主任委员：

张啸川先生，见公司高级管理人员介绍。

执行委员：

张萌女士：商学、经济学硕士。曾任中信银行总行营业部国际业务部主管、日本瑞穗银行悉尼分行资金部助理、澳大利亚康联首域全球资产管理公司全球固定收益与信用投资部基金交易经理、中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部负责人、固定收益部总经理、张萌投资工作室负责人、中邮睿利增强债券型证券投资基金基金经理、中邮增力债券型证券投资基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部总经理、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

委员：

余红女士：经济学学士。曾任上海浦东发展银行股份有限公司北京分行国际部副主管、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部员工、张萌投资工作室员工、中邮稳定收益债券型证券投资基金基金经理助理、中邮货币市场基金基金经理。现任中邮现金驿站货币市场基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮货币市场基金基金经理。

吴昊先生：理学硕士。曾任宏源证券股份有限公司固定收益研究员、中邮创业基金管理股份有限公司固定收益研究员、张萌投资工作室员工、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理助理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮稳定收益债券型基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金经理。

焦洁女士：理学硕士。曾任联合资信评估有限公司工商企业部分析师、中邮创业基金管理股份有限公

---

司研究部债券研究员。现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部固定收益研究员。

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

2. 办理基金备案手续；

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6. 编制中期和年度报告；

7. 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8. 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；

9. 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；

10. 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；

11. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

12. 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；

13. 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；

14. 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

15. 基金托管人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托管人追偿；

16. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

17. 建立并保存基金份额持有人名册；

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并通知基金托管人；

19. 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

20. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

21. 中国证监会规定的其他职责。

### (四) 基金管理人的承诺

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。



---

2. 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
  - (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
  - (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。
- (五) 基金管理人的内部控制体系

---

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1. 公司的内部控制目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护基金份额持有人和股东的合法权益。

2. 公司内部控制遵循的原则

(1) 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

(2) 有效性原则

通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护风险管理制度的有效执行。

(3) 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

(4) 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

(5) 成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法，并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性，尽量降低经营成本，提高经营效益，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(6) 适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

(7) 内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

(8) 防火墙原则

---

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

### 3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

### 4. 内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

(1) 建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

(2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督的责任；

(3) 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

### 5. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

#### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础

---

上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

### (6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

### (7) 监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

---

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

6. 基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

---

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2018年12月31日，中国银行已托管700只证券投资基金，其中境内基金662只，QDII基金38只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

---

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

---

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

(1) 中邮创业基金管理股份有限公司直销中心

住所：北京市东城区和平里中街乙 16 号

办公地址：北京市东城区和平里中街乙 16 号

法定代表人：曹均

联系人：梁超

电话：010-82290840

传真：010-82294138

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

(2) 中邮基金官方微信平台——中邮基金服务号

(3) 中邮创业基金网上直销平台：<https://i.postfund.com.cn>

#### 2. 代销机构

(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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(2) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：王硕

传真：010-68858057

客服电话：95580

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

(3) 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

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

联系人：刘一宁

电话：010-85108227

客户服务电话：95599

网址：<http://www.abchina.com/cn/>

(4) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：杨菲

客户服务电话：95588

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

(5) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

联系人：王琳

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

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

(7) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

---

联系人：王菁

电话：021-58781234

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（8）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦

法定代表人：常振明

联系人：丰靖

客服热线：95558

网址：www.bank.ecitic.com

（9）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

联系人：韩裕

电话：010-66225518

客户服务电话：95526

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

（10）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：王笑

电话：021-68475732

网址：www.bankofshanghai.com

（11）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

客服热线：95511-3

---

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

(12) 首创证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区德胜门外大街 115 号

办公地址: 北京市西城区德胜门外大街 115 号

法定代表人: 毕劲松

联系人: 刘宇

客服电话: 4006-200-620

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

(13) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人: 陈共炎

联系人: 辛国政

联系电话: 010-665682592

客服电话: 4008-888-888

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

(14) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

法定代表人: 张佑君

联系人: 顾凌

电话: 010-84683893

客服电话: 4008-895-548

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

(15) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门内大街 2 号凯恒大厦 B 座 18 层

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

客服电话: 4008-888-108

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

(16) 申万宏源证券有限公司 (原申银万国)

---

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：陈宇

客服电话：95523 或 4008-895-523

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

（17）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

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

（18）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

办公地址：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

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客服电话：95597

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

（19）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

客服电话：95536

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

（20）广发证券股份有限公司

---

注册地址：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：(020)95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

（21）安信证券股份有限公司

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517

网址：www.essence.com.cn

（22）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18、19 层

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：021-20655183

业务传真：021-20655196

客服电话：95547

公司网址：www.hfzq.com.cn

（23）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

客服电话：95565、4008-888-111

网址：www.newone.com.cn

（24）海通证券股份有限公司

---

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：赖奕欣

客户服务电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

(25) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

联系人：乔琳雪

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

(26) 北京辉腾汇富基金销售有限公司

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

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室

法定代表人：李振

电话：010-85610733

传真：010-65174782

联系人：彭雪琳

客服电话：400-057-8855

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

(27) 中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券）

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

(28) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

---

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

电话：021-38784580-8918

客服电话：95351

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

(29) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

法定代表人：曹宏

联系人：金夏

电话：0755-83516289

客服电话：0755-33680000 4006-666-888

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

(30) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：龚俊涛

客服电话：95525

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

(31) 中信证券（山东）有限责任公司

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

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路 28 号五楼

法定代表人：姜晓林

联系人：赵艳青

客服电话：95548

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

(32) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

---

联系人：李荣

联系电话：0769-22115712

客服电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

（33）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

联系电话：010-83561146

客服电话：4006-989-898 或 95399

网址：www.xsdzq.cn

（34）申万宏源西部证券有限公司（原宏源证券）

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

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

法定代表人：李琦

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（35）浙商证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人：吴承根

联系人：高扬

联系电话：021-80108643

客服电话：95345

（36）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

联系电话：025-58519523



---

客服电话：95386

网址：www.njq.com.cn

(37) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

法定代表人：姚志勇

联系人：祁昊

客服电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(38) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

电话：010-59562468

客服电话：95335（0791-95335）、400-88-95335

网址：www.avicsec.com

(39) 国融证券股份有限公司（原日信证券）

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层

法定代表人：张智河

联系人：叶密林、郭一非

电话：010-83991719；010-83991777

客服电话：95385

网址：www.grzq.com

(40) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045152

客服电话：010-66045678

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

---

天相基金网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(41) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

电话：029-87211526

传真：029-87211478

联系人：梁承华

客户服务电话：95582

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

(42) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

客服电话：400-8816-168

开放式基金业务传真：021-58991896

全国统一总机：95511

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

(43) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

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

(44) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

---

法定代表人：冯鹤年

联系人：赵明

客服电话：4006198888

公司网址：www.msq.com

（45）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

（46）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号 13 楼

法定代表人：赵洪波

联系人：姜志伟

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

（47）中国中金财富证券有限公司

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

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

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

法定代表人：龙增来

联系人：万玉琳

电话：0755-82023442

客服电话：95532、4006-008-008

网址：www.china-invs.cn

---

(48) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公区地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

电话：0351-2252792

传真：0351-4110714

客服电话：400-818-8000

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

(49) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：闫丽敏

联系电话：010-67000988-6004

客服电话：400-001-8811

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

(50) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：王欣

电话：021-63325888

客服电话：95503

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

(51) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司（原杭州数米）

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

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

---

(52) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：4009-200-022

网址：licaikexun.com

(53) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

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

(54) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

电话：021-20211847

传真：021-68596919

客服电话：400-700-9665

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

(55) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

联系人：李珍珍

联系电话：13253657368

客服电话：4008-773-772

---

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

(56) 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 (北楼) 25 层

法定代表人: 其实

联系人: 丁姗姗

客服电话: 4001-818-188

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

(57) 浦领基金销售有限公司 (原万银财富)

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人: 聂婉君

联系人: 李艳

传真: 010-64788105

众升客服电话: 400-059-8888

众升财富网址: [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(58) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人: 汪静波

联系人: 王皓

联系电话: 021-80358230

客服电话: 4008-215-399

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

(59) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 詹慧萌

电话: 02120691836

---

传真：021-2069-1861

客服电话：400-820-2899

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

（60）网信证券有限责任公司（原诚浩证券）

注册地址：沈阳市沈河区热闹路 49 号

法定代表人：王嫒

联系人：李玲伊

电话：0755-33066982

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

（61）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

电话：010-83363101

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

（62）中期时代基金销售有限公司（原中期资产）

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 4 层

法定代表人：姜新

联系人：尹庆

客服电话：010-65807865

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

（63）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人：孙燕波

电话：010-85556048

---

传真：010- 85556153

客服电话：400-898-9999

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

（64）晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

办公地址：山西省太原市小店区长风街59号

法定代表人：阎俊生

客服电话：95105588

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

（65）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

办公地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

法定代表人：吴雪秀

联系人：董宣

联系电话：010- 88312877-8005

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

（66）北京钱景基金销售有限公司（原钱景财富）

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：曹金宝

电话：010-59158135

客户服务电话：400-893-6885

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

（67）开源证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：陕西省西安市锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

客户服务电话：95325 或 400-860-8866



---

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

(68) 华安证券股份有限公司

注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 李工

联系人: 范超

客户服务电话: 95318

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

(69) 中信期货有限公司

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

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 18 层

法定代表人: 张皓

联系人: 刘宏莹

电话: 13718246886

传真: 0755-83217421

客户服务电话: 400-990-8826

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

(70) 浙商银行股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市庆春路 288 号

办公地址: 浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人: 沈仁康

联系人: 毛真海

客户服务电话: 95527

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

(71) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号

法定代表人: 高建平

联系人: 李博

客户服务电话: 95561

---

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

(72) 中国国际期货有限公司

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

办公地址: 北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层

法定代表人: 王兵

联系人: 许黎婧

电话: 010-65807848

客服电话: 95162、400-8888-160

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

(73) 中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层

法定代表人: 林炳城

联系人: 刘军

电话: 0755-83734659

传真: 0755-82960582

客户服务电话: 95329

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

(74) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 戎兵

联系人: 张得仙

联系电话: 010-52858244

客户服务电话: 400-6099-200

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

(75) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人: 梁蓉

---

联系人：李慧慧

联系电话：010-66154828-8047

客户服务电话：400-6262-1818

网址：www.5irich.com

（76）北京加和基金销售有限公司（原中经北证）

注册地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室

办公地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室

法定代表人：曲阳

联系人：王晨

联系电话：010-50866170

客服电话：400-803-1188

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

（77）联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

客户服务电话：95564

网址：<http://www.lxsec.com>

（78）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：[金佶](#)

电话：021-54677888-6717

传真：021-33323837

联系人：臧静

客服电话：400-820-2819

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

（79）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

---

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

电话：021-60195121

传真：021-61101630

客服电话：400-921-7755

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

（80）宏信证券有限责任公司

注册地址：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

联系人：杨磊

电话：028-86199665

传真：028-86199079

客服电话：4008-366-366

网址：[www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn)

（81）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

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

（82）北京虹点基金销售有限公司（原乐融多源）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

电话：[010-65951887](tel:010-65951887)

传真：[010-65951887](tel:010-65951887)

联系人：牛亚楠

客服电话：[4006-180-707](tel:4006-180-707)

---

网址: <http://www.hongdianfund.com/>

(83) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人: 蒋煜

联系人: 殷雯

电话: 010-58170949

传真: 010-58170840

客服电话: 4008-188-866

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

(84) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人: 钱昊旻

电话: 010-59336533

传真: 010-59336500

联系人: 沈晨

客服电话: 4008-909-998

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

(85) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人: 李昭琛

电话: 010-62675369

传真: 010-62675979

联系人: 李唯

客服电话: 010-62675369

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

---

(86) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

客服电话：400-619-9059

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

(87) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海浦东新区新金桥路 27 号 1 号楼 证通股份有限公司

法定代表人：桂水发

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：范泽杰

客服电话：400-820-1515

网址：<http://www.zhengtongfunds.com/>

(88) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：胡学勤

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

客服电话：400-821-9031

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

(89) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

---

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

电话：010-52723273

服务热线：95584

公司网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

（90）北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

法定代表人：季长军

联系人：刘鸿

电话：010-52609656

传真：010-51957430

客户服务电话：400-819-6665

网址：<http://www.buyforyou.com.cn/>

（91）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：张林

电话：010-85594745

传真：010-65983333

客户服务电话：400-066-8586

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

（92）和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 6 层

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 6 层

法定代表人：李淑慧

联系人：胡静华

电话：0371-85518396

传真：0371-85518397

---

客户服务电话：4000-555-671

网址：www.hgccpb.com

(93) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(94) 方德保险代理有限公司

注册地址：北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部

办公地址：北京西城区阜成门外大街2号万通新世界A座2107

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

电话：010-56203275

传真：010-68091380

客户服务电话：400-106-0101

网址：www.jhfund.com

(95) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

办公地址：北京市东城区北三环东路36号环球贸易中心A座27层

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

联系方式：010-86499427

客户服务电话：400-620-6868

公司网址：www.lczq.com

(96) 上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼



---

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 18—22 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈媛

客服电话：4008205999

网址信息：www.shhxzq.com

（97）上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-35385521

传真：021-55085991

客户服务电话：400-820-5369

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

（98）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：黄祎

电话：021-63333389

传真：021-63333390

客户服务电话：4006-433-389

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

（99）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：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

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

---

客户服务电话：400-821-0203

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

(100) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：徐江

电话：0411-88891212-119

传真：0411-84396536

客户服务电话：400-6411-999

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

(101) 万家财富基金销售（天津）有限公司

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

办公地址：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

联系人：李明然

电话：010-59013825

传真：010-59013707

客户服务电话：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

(102) 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：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

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

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

(103) 中国国际金融股份有限公司

---

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：任敏、陈曦

客服电话：010-65051166

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

（104）天风证券股份有限公司

办公地址：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

联系人：程晓英

电话：027-87107535

客服电话：400-800-5000

网址：<http://www.tfzq.com>

（105）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区西绒线胡同28号天安国际办公大楼

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

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

（106）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元2层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：袁永姣

客服电话：4000-618-518

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

（107）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

---

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：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：程刚

联系人：张旭

电话：010-58160168

传真：010-58160173

客服电话：400-810-5919

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

(108) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-63136184

客户服务电话：400-817-5666

华夏财富网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(109) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市福田区福华路 355 号皇庭中心 8 楼 DE

法定代表人：高锋

电话：0755-82880158

传真：0755-83655518

联系人：付焱杰

客服电话：400-804-8688

网址：<http://www.foreseakeynes.com/>

(110) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：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

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

---

电话：021-20324155

传真：021-20324199

联系人：孟召社

电话：021-20324176

客服电话：400-928-2266

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

（111）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

联系人：万容

联系电话：010-89188345

客服电话：95118

传真：010-89188000

公司网址：<http://jr.jd.com>

（112）上海联泰资产管理有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

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

（113）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：李强

联系人：王雯

联系电话：0755-83199511

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

（114）通华财富（上海）基金销售有限公司

---

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

电话：021-60818249

传真：021-60818280

联系人：杨徐霆

客服电话：95156

网址：<https://www.tonghuafund.com>

（115）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

电话：18512581255

传真：025-66996699-884131

联系人：喻明明

客服电话：95177

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

（116）深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

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

办公地址：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

联系人：刘明

电话：17503038505

传真：0755-82912445

客服电话：400-680-3928

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

（117）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

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

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

---

联袂念：陈承智

电话：0592-3122673

传真：0592-3122701

客服电话：4009-180-808

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

（118）北京坤元基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

法定代表人：李雪松

联系人：李小鹏

联系电话：13488659469

传真：010-85264540

客服电话：400-818-5585

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

（119）深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙 商务大厦 8 楼 A-1（811-812）

办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1

法定代表人：苗宏升

联系人：王清臣

电话：0411-66889822

传真：0411-66889827

客服电话：4007-903-688

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

（120）华瑞保险销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 32 层

法定代表人：路昊

联系人：茆勇强

电话：021-61058785

传真：021-61098515

---

客服电话：4001-115-818

网址：www.huaruisales.com

（121）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：4006-802-123

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

（122）深圳信诚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3906 室

法定代表人：周文

联系人：殷浩然

电话：010-84865370

客服电话：0755-23946579

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

（123）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融大厦 38 层

法定代表人：张冠宇

联系人：张鼎

电话：010-85932837-2837

客服电话：4008-199-868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

（124）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单

元



---

办公地址：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

联系人：李雯

电话：010-60842306

客服电话：4000-218-850

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

（125）喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：北京市西城区西直门外大街甲 143 号中国印钞造币总公司（凯旋大厦）

A 座 4016

法定代表人：陈皓

电话：010-58349088

传真：010-88371180

联系人：张萌

客服电话：4006-997-719

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

（126）大连网金基金销售有限公司

注册地址：大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层

办公地址：大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层

法定代表人：樊怀东

联系人：辛志辉

电话：0411-39027817

传真：0411-39027835

客服电话：4000-899-100

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

（127）上海挖财基金销售有限公司

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

办公地址：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

联系人：李娟

---

电话：021-50810687

传真：021-50810687

客服电话：021-50810673

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

（128）武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

办公地址：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

电话：027-83863742

传真：027-87006010

联系人：陆锋

客服电话：400-027-9899

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

（129）上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

电话：021-60907379

传真：021-60907397

联系人：徐海峥

客服电话：021-60907378

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

（130）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：田为奇

电话：15601793871

传真：021-68889283

联系人：沈茹意

客服电话：021-68889082

---

网址: [www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

(131) 成都华羿恒信基金销售有限公司

注册地址: 中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

办公地址: 中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

法定代表人: 赵壁

电话: 028-87326832

传真: 028-87326832

联系人: 刘启

客服电话: 4008-010-009

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

(132) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址: 拉萨市北京中路 101 号

办公地址: 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

电话: 021-23586603

传真: 021-23586860

联系人: 付佳

客服电话: 95357

网址: <http://www.18.cn>

(133) 沈阳麟龙投资顾问有限公司

注册地址: 辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址: 辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人: 朱荣晖

电话: 024-62833818

传真: 024-62833813

联系人: 陈巧玲

客服电话: 400-003-5811

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

(134) 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市生态大街 6666 号

---

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

（135）五矿证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

法定代表人：黄海洲

联系人：华然

客服电话：4001-840-028

网址：<http://www.wkzq.com.cn>

（136）海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：惠晓川

电话：021-80133597

传真：021-80133413

联系人：秦琼

客服电话：400-808-1016

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

（137）深圳前海财厚基金销售有限公司

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

办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

电话：0755-86575665

传真：0755-26640652

联系人：胡闻智

客服电话：400-128-6800

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

（138）阳光人寿保险股份有限公司

---

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京朝阳区朝外大街乙 12 号昆泰国际大厦 1 号楼 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

电话：010-59053660

客户服务电话：95510

公司网址：<http://fund.sinosig.com>

(139) 江苏天鼎证券投资咨询有限公司

地址：江苏省南京市鼓楼区平安里 74 号

法定代表人：方有伟

电话：025-66001159

传真：025-58591481

联系人：黄丹昀

客服电话：025-962155

网址：<http://www.tdtz888.com>

扬州国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320

法定代表人：刘晓光

客服电话：400-021-6088

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

(141) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

(二) 基金注册登记机构

---

名称：中邮创业基金管理股份有限公司  
住所：北京市东城区和平里中街乙 16 号  
办公地址：北京市东城区和平里中街乙 16 号  
法定代表人：曹均  
联系人：李焱  
电话：010-82295160  
传真：010-82292422

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海市海华永泰律师事务所  
住所：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室  
负责人：冯加庆  
联系人：张兰  
电话：021-58773177  
传真：021-58773268  
经办律师：梁丽金、张兰

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：致同会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：北京市建国门外大街 22 号赛特广场五层  
执行事务合伙人：徐华  
联系人：卫俏嫔  
联系电话：010-85665232  
传真电话：010-85665320  
经办注册会计师：卫俏嫔 李惠琦

---

## 六、基金的历史沿革与存续

### （一）本基金的历史沿革

中邮中证 500 指数增强型证券投资基金由中邮上证 380 指数增强型证券投资基金变更而来。中邮上证 380 指数增强型证券投资基金经中国证监会 2011 年 8 月 9 日《关于核准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1261 号)的核准,进行募集,基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金自 2011 年 9 月 28 日至 2011 年 11 月 18 日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认(证监许可[2011]1261 号),《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 22 日起正式生效。

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金自 2019 年 11 月 11 日至 2019 年 12 月 10 日以通讯方式召开基金份额持有人大会,大会审议通过了《关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金转型有关事项的议案》,内容包括对中邮上证 380 指数增强型证券投资基金变更投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、收益分配原则、费率水平及修订基金合同等,并同意将转型后基金更名为“中邮中证 500 指数增强型证券投资基金”,上述基金份额持有人大会决议自决议通过之日起生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

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

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

---

## 七、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书中列明及基金管理人网站公示。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以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的申购与赎回。

### (二) 申购和赎回的开放日及开放时间

#### 1. 开放日及开放时间

本基金的开放日为本合同生效后基金管理人公告开始办理申购或赎回之日,具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

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并公告。

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、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2. 申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

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。

### (三) 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日基金份额净值为基准进行计算；

2. 基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，确认日期在前的基金份额先赎回，确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4. 当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时



---

间结束后不得撤销；

5. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1. 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

##### 2. 申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日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。

##### 3. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

#### (五) 申购和赎回的数额限制

##### 1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构首次申购单笔最低限额为人民币 1000 元；投资者通过直销机构首次申购单笔最低限额为人民币 50000 元，但已认购本基金的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币 1000 元；追加申购单笔最低限额为人民币 1000 元（通过本基金管理人基金网上交易系统特定交易方式认购本基金暂不受此限制）。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

##### 2. 申请赎回基金的份额

---

单笔赎回不得少于 10 份(如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 10 份, 则必须一次性赎回基金全部份额); 若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足 10 份时, 基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

在不低于上述规定的基金份额下限的前提下, 如基金销售机构有不同规定, 投资者需同时遵循该销售机构的相关规定;

3. 基金管理人可以根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介及基金管理人网站上公告。

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

#### (六) 申购份额与赎回金额的计算方式

1. 申购份额的计算方式: 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后, 以申请当日基金份额净值为基准计算, 各计算结果均按照四舍五入方法, 保留小数点后 4 位, 由此误差产生的损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有。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。

##### (1) 申购 A 类基金份额

申购份额的计算公式如下:

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

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

(对于适用固定金额申购费的申购, 申购费用=固定申购费金额)

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

举例说明: 假定 T 日的 A 类基金份额净值为 1.2000 元, 某投资人投资 10000 元申购本基金 A 类份额, 计算如下:

适用申购费率为 1.5%

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.2000 = 8210.18 \text{ 份}$$

即: 投资者投资 10000 元申购本基金 A 类基金份额, 假设申购当日 A 类基金份额净值

为 1.2000 元，则可得到 8210.18 份 A 类基金份额。

(2) 申购 C 类基金份额

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例：某投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0180 元，无申购费率，则其可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=100,000/1.0180=98,231.83 份

即：投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0180 元，则可得到 98,231.83 份 C 类基金份额。

2. 赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

举例说明：假定 T 日的 A 类基金份额净值为 1.2000 元，赎回 A 类基金份额为 10000 份，各时期赎回金额如下：

持有期限	适用费率	赎回总金额	赎回费用	赎回金额
0 天至 7 天	1.50%	10000*1.2=12000	12000*1.50%=180	12000-180=11820
7 天(含 7 天)至 30 天	0.1%	10000*1.2=12000	12000*0.10%=12	12000-12=11988
30 天(含)以上	0.00%	10000*1.2=12000	12000*0.00%=0	12000-0=12000

(七) 申购和赎回的费用及其用途

1. 本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2. 本基金的申购费用由申购本基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额 (M 元,前收费)	申购费率
M<100 万元	1.5%

100 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产

3. 本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额采用相同的赎回费率结构，随持有期限的增加而递减。具体如下：

持有时间	赎回费率
N < 7 天	1.5%
7 ≤ N < 30 天	0.1%
N ≥ 30 天	0

对于赎回时份额持有不满 30 天的，收取的赎回费全额计入基金财产。

4. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种指定媒介上公告。

#### 5、关于实施特定投资群体申购基金的费率政策

本基金对特定客户投资群体实行申购费率优惠政策。特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。对于通过中邮基金直销中心申购本基金的特定投资群体的申购费率，统一实施为原申购费率的 2 折，即特定申购费率 = 原申购费率 × 0.2；若原申购费率适用于固定费用的，则执行原固定费用，不再享有费率折扣。

#### (八) 申购与赎回的注册登记

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

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

3. 投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理

---

相应的注册登记手续。

4. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

(九) 巨额赎回的认定及处理方式

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，当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资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) 当基金出现巨额赎回时，如发生单个开放日内单个基金份额持有人赎回申请超过前一开放日基金总份额 10%的情形，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，可以先行对该单个基金份额持有人超出前一开放日基金总份额 10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人前一开放日基金总份额 10%以内(含 10%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述(1)或(2)方式处理，具体见招募说明书或相关公告。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，

---

当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资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。

(4) 暂停赎回：连续 2 日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

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，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### (十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- (2) 证券交易场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；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- (4) 基金财产规模过大，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，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

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

(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) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2. 在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- (2) 证券交易场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；
- (3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

---

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况；

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

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当指定媒介上刊登公告。除非发生巨额赎回，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3. 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。。

4. 暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登公告。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介和基金管理人网站上，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开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介和基金管理人网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

#### (十一) 基金转换

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

#### (十二) 基金的非交易过户、转托管与冻结

1. 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会

---

团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

2. 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

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

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

4. 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。



---

## 八、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金为股票指数增强型基金，以指数化分散投资为主，适度的增强型主动管理为辅，在严格控制跟踪偏离风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### (二) 投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

### (三) 投资策略

本基金为股票指数增强型基金，以中证 500 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收

---

益之间的最佳匹配。

当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金的投资策略包括以下几个层面：

### 1、资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金，采用“被动投资为主，主动增强为辅”国际通行的量化多因子选股模型进行的投资策略投资。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定）。

### 2、股票投资策略

本基金采用的量化模型主要分为“多因子模型”和“组合优化模型”、“风险模型”三个部分：

#### （1）多因子模型

首先，我们筛选出在 A 股具备长期超额收益的单因子构建因子池，单因子选择上，既要保证单因子超额收益的稳定性和统计学上的显著，也要保证因子具备一定的投资逻辑。单因子主要基于财务数据和量价数据构建，包括但不限于以下指标：

- 1) 估值类因子：如市盈率、市净率、市销率等；
- 2) 盈利类因子：如总资产收益率、净资产收益率等；
- 3) 成长类因子：营业收入同比、净利润同比、经营现金流同比等；
- 4) 质量类因子：资产负债率、账面市值比等；
- 5) 一致预期类因子：预期净利润、预期营业收入等；

- 
- 6) 动量/反转类因子：20 日收益率、240 日收益率等；
  - 7) 波动性因子：过去一个月日收益标准差、过去六个月日收益标准差等；
  - 8) 流动性因子：过去一个月日均成交量、过去一个月日均换手率等；
  - 9) 规模类因子：总市值、流动市值等；
  - 10) 其他：如分红类因子、其他技术类因子等；

之后，应用 ICIR、机器学习等方法对个股进行打分或收益率预测。

#### (2) 组合优化模型

我们将通过组合优化模型确定最终的投资组合，在模型构建时，包括但不限于以下限制条件：

- 1) 交易成本；
- 2) 组合相对基准指数的行业、市值偏离以及各类风险因子敞口（详见风险模型）；
- 3) 投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例；
- 4) 日均跟踪偏离度；

#### (3) 风险模型

通过构建风险模型控制投资组合在各类风险因子上的敞口，降低组合相对指数超额收益的波动，风险因子包括但不限于行业、规模、波动、成长等；

### 3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期；通过对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略；通过对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略。

### 4、股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎

---

回变动情况、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### （1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证 500 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成分股调整生效前，分析并确定组合调整策略，并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### （2）不定期调整

若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。

此外，我们将根据组合效果、市场状况及交易成本等多个因素确定量化多因子选股模型的调仓频率。

### 5、跟踪误差控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。

### 6、股指期货投资策略

本基金在风险可控的前提下，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。选择流动性好且交易活跃的合约，根据对证券市场走势的判断，通过买入期货合约降低建仓期股票价格大幅上涨的风险，通过卖出期货合约对冲现货市场的下行风险。此外，通过股指期货的投资，还可以提升资金使用效率，降低仓位调整的交易成本以及跟踪误差。

### 7、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

---

## 8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

### (四) 业绩比较基准

中证 500 指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金或市场推出代表性更强、投资人认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并按照监管部门的要求履行适当程序，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。

### (五) 风险收益特征

本基金是股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### (六) 投资决策依据、决策程序和决策调整

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

#### 1. 投资决策依据

- (1) 国家有关法律法规和本基金基金合同的有关规定；
- (2) 标的指数编制、调整等相关规定，以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略；

---

(3) 本基金对宏观经济走向、产业发展演变及上市公司基本面进行深入分析,对上市公司未来业绩进行预测,通过一定的价值评判标准对上市公司的投资价值进行分析,并在此基础上进行增强投资。

## 2. 投资决策程序

本基金的投资决策机制为,实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、行业研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:

(1) 策略研究员、行业研究员、债券研究员、金融工程研究员各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

(2) 金融工程小组利用量化模型进行指数化投资、投资组合优化和跟踪误差模拟测算,在此基础上进行投资论证,做出投资建议提交给基金经理,并为投资决策委员会提供资产配置的依据。

(3) 基金经理根据金融工程小组提交的指数组合优化及风险测算的结果以及投资研究部提交的投资建议初步决定下一阶段的投资组合策略,形成资产配置提案报投资决策委员会。

(4) 投资决策委员会每月召开投资策略会议,决定基金的大类资产配置比例和股票、债券的投资重点等。

(5) 投资总监每周召集投资例会,根据投资决策委员会的决定,结合市场和公司基本面的变化,决定具体的投资策略。

(6) 基金经理根据投资决策委员会的决策制定相应的指数化投资组合投资和优化方案,对超出基金经理权限的投资决策须报投资决策委员会审议核准。

(7) 基金经理根据经投资决策委员会批准的基金投资组合方案,向交易部下达交易指令。

(8) 交易部执行基金经理的交易指令,对交易情况及时反馈。

(9) 风险控制部门负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估,定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时,通知基金经理和相关部门及时进行投资组合的调整。

(10) 风险控制部门根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

---

### 3. 投资决策调整

在正常市场情况下,本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### (七) 投资限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%,其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。

(2) 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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3) 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%;

(4) 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%;

(5) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

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

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

(8) 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;

(9) 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%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

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

---

合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(13) 本基金参与股指期货交易依据以下标准构建组合：

(13.1) 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%；

(13.2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

(13.4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的 90%-95%；

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

(14) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(15) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；出借期限在 10 个交易日以上的出借证券与其他流动性受限证券之和，不得超过基金资产净值的 15%；参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述（2）、（7）、（10）、（11）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同



---

的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

#### (九) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

#### (十) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金资产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

---

(十一) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

---

## 九、基金的财产

### (一) 基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### (四) 基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
3. 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范围。
4. 基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

---

## 十、基金财产的估值

### （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、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1.对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2.对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3.如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### （四）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不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、股指期货合约估值方法

---

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

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

7、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净值信息的计算结果对外予以公布。

#### （五）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 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值，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本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或

---

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

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

---

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

#### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (八) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值和基金份额累计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、基金份额净值和基金份额累计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。

#### (九) 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 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现错误的，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。



---

## 十一、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、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；

2、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

### （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。

---

## 十二、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类份额的销售服务费；
- 4、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、审计费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用或结算费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的账户开户费用和维护费用；
- 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.6%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2. 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

3、C 类份额的销售服务费；

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。C 类份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类份额的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的基金资产净值

C 类份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4. 基金的指数许可使用费

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 0.016% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

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从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数使用许可费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

如果指数使用许可协议约定的标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标的指数许可使用费。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使

---

用费费率、具体计算方法及支付方式。

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

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

(五) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

---

## 十三、基金的会计和审计

### (一) 基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
3. 会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
4. 本基金独立建账、独立核算。
5. 本基金会计责任人为基金管理人。
6. 基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法規规定编制基金会计报表，基金托管人定期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) 基金审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
2. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。
3. 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；

---

## 十四、基金的信息披露

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

### （二）信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

（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、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、《基金合同》、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额

---

持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在3个工作日内更新招募说明书并登载在指定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新招募说明书。

(3) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后,基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在3个工作日内,更新基金产品资料概要,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。

(4) 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,将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上,将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上,并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

---

基金管理人在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载在指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在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网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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。

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

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

#### 7、临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；



- 
- (2) 终止《基金合同》、基金清算；
  - (3) 转换基金运作方式、基金合并；
  - (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
  - (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
  - (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
  - (7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
  - (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
  - (9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
  - (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
  - (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
  - (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
  - (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
  - (14) 基金收益分配事项；
  - (15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
  - (16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
  - (17) 本基金开始办理申购、赎回；
  - (18) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
  - (19) 基金变更标的指数；
  - (20) 基金推出新业务或服务；
  - (21) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
  - (22) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
  - (23) 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；

---

(24) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

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

#### 8、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，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### 9、清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 10、投资股指期货相关公告

本基金将在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，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。

#### 11、投资资产支持证券相关公告

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

#### 12、参与融资和转融通证券出借交易的相关公告

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

#### 13、中国证监会规定的其他信息。

##### （六）信息披露事务管理

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

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

---

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

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

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

---

## 十五、风险揭示

本基金为股票指数增强型基金，以中证 500 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在基本面深入研究与量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险以及其他风险。

### (一) 投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险

#### 1. 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

##### (1) 政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### (2) 经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### (3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

##### (4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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，但不能完全避免。

##### (5) 购买力风险

---

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### (6) 汇率风险

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

#### (7) 债券收益率曲线变动的风险

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

#### (8) 再投资风险

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

### 2. 流动性风险

为应对投资者的赎回申请，基金管理人可采取各种有效管理措施，满足流动性需求。但如果出现较大数额的赎回申请，基金资产变现困难时，基金面临流动性风险。

#### (1) 基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详细规则参见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定。

#### (2) 拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金拟投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板和创业板)、债券、货币市场工具、资产支持证券、以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具，同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

为应对巨额赎回情形下可能发生的流动性风险，基金管理人在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，可能采取部分延期赎回、暂停赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的流动性风险管理措施，详细规则参见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定。

#### (4) 由于投资者的申购赎回行为可能导致本基金的单一投资者持有的份额占本基金总

---

份额的比例较高，该单一投资者的申购赎回行为可能影响本基金的投资运作，从而对基金收益产生不利影响。基金管理人将控制单一投资者持有基金份额的比例低于 50%，并防止投资者以其他方式变相规避 50%集中度限制的情形发生（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外）。如基金管理人认为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%，或者基金管理人认为可能存在变相规避 50%集中度限制的情形时，基金管理人有权拒绝该单一投资者的全部或部分的认/申购申请或确认失败。

（5）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商一致，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。

巨额赎回情形下实施部分延期赎回、暂停赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的情形及程序详见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回第十条的相关约定。当实施部分延期赎回的措施时，申请赎回的基金份额持有人将无法全额确认赎回，一方面可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。若实施暂停接受赎回申请，投资者一方面不能赎回基金份额，可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。当实施对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的措施时，该赎回比例过高的基金份额持有人将无法全额确认赎回，一方面可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。

收取短期赎回费的情形和程序详见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定，对持续持有期小于 7 日的投资者相比于其他持有期限的投资者将支付更高的赎回费。

暂停基金估值的情形详见招募说明书第十一部分基金资产的估值的相关约定。若实施暂

---

停基金估值，基金管理人会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，对投资者产生的风险如前所述。

当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金的估值采用摆动定价机制，即将本基金因为大额申购或赎回而需要大幅增减仓位所带来的冲击成本通过调整基金的估值和单位净值的方式传导给大额申购和赎回持有人，以保护其他持有人的利益。在实施摆动定价的情况下，在总体大额净申购时会导致基金的单位净值上升，对申购的投资者不利；在总体大额净赎回时会导致基金的单位净值下降，对赎回的持有人产生不利影响。

### 3. 信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金财产损失。

#### (二) 管理风险

(1) 在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

(2) 基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

#### (三) 合规性风险

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。

#### (四) 操作或技术风险

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

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

#### (五) 本基金的特定风险

本基金为股票指数增强型基金，属于被动投资产品。其特定风险主要包括：

##### 1. 跟踪误差风险

跟踪误差风险是指数型基金面临的主要风险，跟踪误差度量基金投资组合收益率与目标指数收益率的偏离度，跟踪误差扩大将造成基金投资组合偏离目标指数的风险。本基金的指

---

数化管理具有较强的专业性,强调基金单位净值增长率与业绩衡量基准增长率之间的一致性,要求基金管理人在资产运作过程中有科学严密的风险控制机制和程序,以保障基金资产不因个股的风险管理不当而造成资产配置失衡,对一致性表现造成威胁。

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离:

- 由于本基金采用增强型指数跟踪方法,基金投资组合的成分股及各成分股权重与标的指数成分股权重存在差异,使本基金投资组合收益与标的指数收益存在偏离。

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

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

- 成分股派发现金红利、新股市值配售等导致基金收益率偏离标的指数收益率,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度和跟踪误差。

- 由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金费用的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

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

## 2. 标的指数风险

由于标的指数自身的特点和编制方法的选择,导致其表现与总体市场表现存在差异,目标指数成分股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

## 3. 标的指数变更风险

根据基金合同规定,如出现变更目标指数的情形,本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资组合将随之调整,基金的风险收益特征将与新的目标指数保持一致,投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

## 4. 量化模型风险

本基金采用量化模型构建股票投资组合,但并不基于量化策略进行短期频繁交易。本基金投资过程中的多个环节将依赖于量化模型,存在模型失效导致基金业绩表现不佳的风险。

## 5. 投资资产支持证券的特定风险

本基金可投资资产支持证券,投资资产支持证券可能面临资产支持证券的标的信用风险、



---

流动性风险及证券化过程中的法律风险等，由此可能导致基金或基金份额持有人利益受损。

#### 6. 股指期货风险

本基金使用股指期货作为风险对冲工具，股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失，存在潜在损失可能成倍放大的风险。

#### (六) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

---

## 十六、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。

2. 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效之日起按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

3. 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止；
2. 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
3. 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
4. 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### (三) 基金财产的清算

1. 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2. 基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资

---

格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

### 3. 清算程序

(1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

(3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

(4) 对基金财产进行评估和变现；

(5) 制作清算报告；

(6) 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；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

### 4. 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

### 5. 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

### 6. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组

---

进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上

7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

---

## 十七、基金合同内容摘要

(一) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

1. 基金管理人的权利与义务

- 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》及有关法律的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定, 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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案;
- 11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
- 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- 13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资及转融通;
- 14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- 16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
- 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) 基金管理人的义务

- 
- 1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
  - 2) 办理基金备案手续；
  - 3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
  - 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
  - 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
  - 6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
  - 7) 依法接受基金托管人的监督；
  - 8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
  - 9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
  - 10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
  - 11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
  - 12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
  - 13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
  - 14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
  - 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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
  - 25) 建立并保存基金份额持有人名册;
  - 26) 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。

## 2. 基金托管人的权利与义务

- 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,为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算。

- 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) 基金托管人的义务

- 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和证券账户等投资所需账户,按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

12) 建立并保存基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金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定；



---

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3. 基金份额持有人的权利与义务

基金份额持有人的权利：

- 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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会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。

基金份额持有人的义务：

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 4) 交纳基金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。

4. 本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

#### (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 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。本基金基金份额持有人大会未设立日常机构。

2. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金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。

3. 在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内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) 调低除基金管理费与基金托管费以外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、调低赎回费率，或者调整基金份额类别及基金份额分类办法、规则；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

4.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开时，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。

#### 5.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) 授权委托书证明的内容要求(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书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

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

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

2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基

---

金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

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二分之一（含二分之一）；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小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具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，并与基金登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

（3）在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（4）基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## 7. 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。

## 8.表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

(2) 特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。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，表决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。

## 9.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。

## 10.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。

11.参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于50%的，召集人可以在原公告基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。重新召集基金份额持有人大会的通知、形式、议事程序、表决、生效和公告等适用本合同中有关基金份额持有人大会的规定。

12.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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议

### (三) 基金的收益与分配原则、执行方式

#### 1.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。

#### 2.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。

#### 3.基金收益分配原则

(1) 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；

(2) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4.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。



## 5.收益分配方案的确定、公告与实施

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

## 6.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。

### (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1.基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) C类份额的销售服务费；
- (4) 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、审计费、律师费和诉讼费；
- (7) 基金份额持有人大会费用；
- (8) 基金的证券、期货交易费用或结算费用；
- (9) 基金的银行汇划费用；
- (10) 基金的账户开户费用和维护费用；
- (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。

#### 2.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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.6\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

##### (2) 基金托管人的托管费

---

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) C类份额的销售服务费；

本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提。C类份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的C类份额的销售服务费

E为C类份额前一日的基金资产净值

C类份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

(4) 基金的指数许可使用费

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0.016%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

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从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数使用许可费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

---

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

如果指数使用许可协议约定的标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标的指数许可使用费。此项变更无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费率、具体计算方法及支付方式。

上述“1.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。

### 3.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。

### 4.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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### （五）基金财产的投资方向和投资限制

##### 1. 投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。

---

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 2. 投资限制

### (1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%。

2) 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3) 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%；

4) 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%；

5) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

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

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

8) 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；

9) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

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

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

---

12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

13) 本基金参与股指期货交易依据以下标准构建组合：

13.1) 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%；

13.2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

13.4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的90%-95%；

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

14) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

15) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的出借证券资产不得超过基金资产净值的30%；出借期限在10个交易日以上的出借证券与其他流动性受限证券之和，不得超过基金资产净值的15%；参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述2)、7)、10)、11)情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

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

---

## (2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

## (六) 基金资产估值方法

### 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不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

---

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、股指期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

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

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

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

---

双方协商解决。

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

#### (七) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、《基金合同》的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本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自生效后方可执行，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

##### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

##### 3、基金财产的清算

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

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

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

##### (4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；



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

(5) 基金财产清算的期限为6个月, 但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的, 清算期限相应顺延。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告, 基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在制定报刊上。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### (八) 争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对各方当事人均有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金

---

合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。《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。。

---

## 十八、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### 1. 基金管理人(或简称“管理人”)

名称： 中邮创业基金管理股份有限公司

住所： 北京市东城区和平里中街乙16号

法定代表人：曹均

成立时间：2006年5月8日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2006]23号

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 3.041亿元人民币

经营范围： 发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间： 持续经营

#### 2. 基金托管人(或简称“托管人”)

名称： 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：刘连舸

成立时间： 1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理

---

发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间： 持续经营

## (二) 托管协议的依据、目的、原则和解释

### 1. 依据

本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《中邮中证500指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。

### 2. 目的

本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《中邮中证500指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。

### 3. 原则

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

### 4. 解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《基金合同》的相应术语具有相同含义。

## (三) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1. 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：

(1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的中证500指数股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债

---

券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、股指期货、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90-95%,其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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、应收申购款等;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

(2) 对基金投融资比例进行监督;

1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90-95%,其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%。

2) 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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

3) 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%;

4) 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%;

5) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

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

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

8) 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;

9) 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%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%;因

---

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

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

12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

13) 本基金参与股指期货交易依据以下标准构建组合：

13.1) 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%；

13.2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

13.4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的90%-95%；

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

14) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

15) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的出借证券资产不得超过基金资产净值的30%；出借期限在10个交易日以上的出借证券与其他流动性受限证券之和，不得超过基金资产净值的15%；参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述2)、7)、10)、11)情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的

---

有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，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，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需另行召开基金份额持有人大会。

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

(3) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露登载基金业绩表现数据等进行复核。

(4) 基金托管人在上述第(1)、(2)款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(5) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(6) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

#### (四) 基金管理人对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、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、无正

---

当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

#### (五) 基金财产的保管

##### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2. 基金合同生效前募集资金的验资和入账

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

##### 3. 基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。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，均需通过本基金的银行账户进行。

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



---

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### 4. 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

#### 5. 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。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) 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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

#### 6. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的

---

重大合同时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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

#### (六) 基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、第三方估值机构发送的数据错误，

---

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减轻或消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

#### (七) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于20年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

#### (八) 争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### (九) 托管协议的变更与终止

##### 1. 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

##### 2. 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

(1) 《基金合同》终止；

- 
- (2)本基金更换基金托管人;
  - (3)本基金更换基金管理人;
  - (4) 发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

---

## 十九、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。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要、市场状况及自身服务能力的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### (一) 注册登记服务

本基金管理人作为注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。我公司配备了安全、高效、完善的电脑及通讯系统，能够及时、准确地为基金份额持有人办理基金账户和基金份额的登记、基金管理、基金份额托管和转托管、基金份额持有人名册管理、权益分配时红利登记和派发、基金交易份额清算、基金非交易过户、基金交易资金的交收等业务。

### (二) 红利再投资服务

基金份额持有人若选择红利再投资形式进行基金收益分配，该基金份额持有人当期分配所得现金红利将按除息日的基金份额净值自动转为基金份额，且免收再投资的费用。

### (三) 定期定额投资计划

在条件成熟的情况下，本基金可为投资人提供定期定额投资服务，具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公布的业务规则为准。

### (四) 网上交易服务

在条件成熟的情况下，为客户提供网上交易平台。通过网络通讯技术，为客户提供安全、高效的基金交易服务。

### (五) 客户分级服务

根据客户持有基金份额，划分出六个级别，根据不同级别客户需求给予更全面、更优质、更个性化的服务。

### (六) 信息查询服务

客户可以通过自动与人工两种查询方式及时了解公司信息、产品信息、投资资讯等。

自动查询：我公司开通 24 小时自动语音服务、网上查询服务。客户可以通过拨打客服电话通过自动语音进行信息查询，也可以通过网站账户查询系统及时了解账户信息和交易信息；

人工查询：客户可以在工作时间通过拨打客服电话直接与客服人员进行业务咨询或交流，也可以通过语音电话留言、网站留言、客服邮箱的方式和我公司取得联系，公司客服人员会在最短的时间内和您联络，竭诚为您服务。

---

查询内容包括：最新活动公告、基金产品介绍、公司介绍等公司信息；基金净值查询、基金份额查询、基金交易确认查询、基金分红查询及基金历史交易记录等账户及交易信息等。

(七) 主动通知服务

我公司会根据业务开展情况，通过信函、电子邮件、短信、电话等方式主动为基金份额持有人提供各项通知服务，包括公司信息、产品信息、交易信息、投研资料及重要信息提示等。

(八) 对账单寄送服务

我公司会根据相关规则，定期为基金份额持有人提供对账单邮寄服务。

(九) 信息定制服务

为进一步提升服务品质，我公司推出服务定制业务。基金份额持有人可通过客服热线、公司网站等途径，按照我公司服务定制规则和定制范围，定制各种资讯，公司会通过 EMAIL、短信、信函等多渠道发送相关资讯与资料。

(十) 投诉建议受理

如果客户对我公司提供的各种服务感到不满或有其它需求，可拨打投诉电话或通过语音留言、客服邮箱、网站留言等各种方式随时向我公司提出，我公司将及时处理客户投诉和建议。

(十一) 客户服务中心联系方式

1. 客户服务部电话

客户服务电话：400-880-1618

客户投诉电话：(010)58511618

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

3. 客服信箱：[info@postfund.com.cn](mailto:info@postfund.com.cn)

---

## 二十、其他披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并予以公告。

---

## 二十一、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，基金份额持有人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。



---

## 二十二、备查文件

- (一) 中国证监会批准本基金设立的文件；
- (二) 《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《中邮创业基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》；
- (四) 《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《法律意见书》；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处；

查阅方式：基金份额持有人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

