

中海上证 50 指数增强型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2021 年第 2 号)

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请已于2010年1月7日获中国证监会证监许可【2010】20号文核准。

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

投资有风险，投资者认购或申购本基金时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，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、数量等投资行为做出独立决策。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。在投资人做出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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

本基金跟踪上证 50 指数，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书（更新）所载内容截止至 2021 年 3 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪 言.....	4
二、释 义.....	5
三、基金管理人.....	11
四、基金托管人.....	22
五、相关服务机构.....	27
六、基金的募集.....	65
七、基金合同的生效.....	69
八、基金份额的申购和赎回.....	71
九、基金的投资.....	82
十、基金业绩.....	97
十一、基金的财产.....	99
十二、基金资产的估值.....	101
十三、基金的收益与分配.....	107
十四、基金的费用与税收.....	109
十五、基金的会计与审计.....	112
十六、基金的信息披露.....	113
十七、风险揭示.....	120
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	127
十九、基金合同的内容摘要.....	130
二十、基金托管协议的内容摘要.....	158
二十一、对基金份额持有人的服务.....	178
二十二、其他应披露的事项.....	181
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	184
二十四、标的指数的编制方法及指数信息查阅方式.....	185
二十五、备查文件.....	187

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、等相关法律法规和《中海上证50指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中海上证50指数增强型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。本基金根据本招募说明书所载明的资料申请募集。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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金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。基金投资人欲了解本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,下列词语或简称代表如下含义:

《基金合同》	《中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件及其制定机构所作出的修订、补充和有权解释
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《流动性风险管理规定》	《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的中海上证 50 指数增强型证券投资基金
招募说明书	《中海上证 50 指数增强型证券投资基金招募说明书》,即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的信息披露、风险揭

	示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其更新
基金产品资料概要	指《中海上证 50 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	基金管理人与基金托管人签订的《中海上证 50 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
发售公告	《中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》
《业务规则》	《中海基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的银行业监管机构
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	基金管理人及基金代销机构

基金销售网点	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	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
基金注册登记机构	中海基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之



	日
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	基金存续期内，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为
巨额赎回	在单个开放日，本基金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）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额

	额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金申购、赎回、转换及转托管等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的且由同一基金注册登记机构办理注册登记的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入
基金资产总值	基金所拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	估值日基金资产净值除以估值日发行在外的基金份额总数的数值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程

流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
摆动定价机制	指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
货币市场工具	现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒介	中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“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
不可抗力	基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

邮政编码：200120

成立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：黄乐军

总经理：黄乐军（代）

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

**【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】**

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[2004]24 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

联系人：葛玮赓

电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司 41.591%

国联证券股份有限公司 33.409%

法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司 25.000%

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司董事长，四川信托有限公司董事长。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理，中海信托股份有限公司总裁。

刘显忠先生，董事。中央财经大学硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司党委委员、财务总监。目前兼任：中国信托业保障基金有限责任公司监事、信达证券股份有限公司监事，历任青岛华兴有限公司职员，中国海洋石油总公司资产管理岗主管、信息处长、信息经理、信息管理经理，中海石油（中国）有限公司资本市场管理经理、资本市场处处长兼媒体与公共关系处处长，中国海洋石油总公司有限机关投资者关系部（董事会办公室）媒体与公共关系处处长，中海信托股份有限公司总信息师。

杨皓鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委书记、人力资源部经理、资产经营部经理，中海基金管理有限公司总经理助理、代理督察长、总经理。

葛小波先生，董事。清华大学硕士。现任国联证券股份有限公司执行董事、总裁兼财务负责人，兼华英证券有限责任公司董事。历任中信证券股份有限公司投资银行部经理、高级经理，风险控制部副总经理、执行总经理，权益投资部和股权衍生品部行政负责人，党委委员、执委委员、财务总监，党委委员、固定收益部行政负责人，党委委员、执委委员、财务总监和首席风险官。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、总裁助理、资产管理部总经理、副总裁兼资产管理部总经理。

Philippe CIEUTAT先生，董事。法国国籍。ESSEC管理学院AACSB认证（等同于MBA）。现任法国爱德蒙得洛希尔银行执行委员、首席执行官。历任Mazars & Guerard审计咨询公司高级金融审计员，汇丰银行集团金融服务高级审计经理，汇丰银行全球资产管理公司财务总监，汇丰银行（法国）战略和计划主管，法国爱德蒙得洛希尔银行执行委员、财务总监及首席行政官。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDONG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任北京市中伦律师事务所合伙人。历任Sidley Austin（盛德律师事务所）芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

## 2、监事会成员

张悦女士，监事长。中国石油大学硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司党委委员、合规总监。目前兼任：国联期货股份有限公司监事，历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监、党办主任、信托事务管理总部总经理、总稽核。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学硕士、法国国立电信管理学院硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理（香港）有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人

员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长以及爱德蒙得洛希尔（瑞士）业务发展经理。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司财务总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员、爱德蒙得洛希尔（瑞士）商务拓展部高级副总裁。

吴幸，职工监事。悉尼大学硕士。现任中海基金管理有限公司人力资源部总经理。历任中海基金管理有限公司人力资源专员、人力资源高级经理、人力资源部副总经理。

章悦，职工监事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司监察稽核部总经理。历任德勤华永会计师事务所审计员，蒂森克虏伯电梯有限公司中国区总部内审经理，华宝兴业基金管理有限公司内控审计风险管理部高级内审经理、监察稽核部部门主管、监察稽核部部门总经理助理。

### 3、高级管理人员

黄乐军先生，督察长。厦门大学法律硕士。历任北京近铁运通运输有限公司厦门分公司职员、上海市公安局副主任科员、上海证监局主任科员、海富通基金管理有限公司监察稽核总监。2018年2月进入本公司工作，2018年3月至今任本公司督察长。2021年1月起兼任本公司代理总经理。

李俊先生，副总经理。东南大学计算机软件专业学士。历任华光电子工业有限公司技术员，国联证券股份有限公司电脑技术部运维经理、副总经理，联狐信息技术有限公司信息技术部总监，中海基金管理有限公司信息技术部总经理，国联证券股份有限公司资产管理部副总经理、资产管理部总经理、上海分公司总经理。2020年9月进入本公司工作，曾任总经理助理，2020年9月至今任本公司副总经理兼首席信息官。

### 4、基金经理

彭海平先生，中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2015年7月至2019年1月任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理，2018年4月至2019年3月任中海中鑫灵活

配置混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至2019年4月任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至2019年4月任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理，2016年4月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2018年9月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理。

#### 5、历任基金经理

本基金基金合同于2010年3月25日生效，历任基金经理如下表：

基金经理姓名	管理本基金时间
陈明星	2010年3月25日-2013年1月7日
彭海平	2013年1月8日-至今

#### 6、投资决策委员会成员

黄乐军先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司督察长、代理总经理。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司权益投资部总经理、权益投资总监、代固定收益投资部总经理、代固定收益投资总监、基金经理。

邱红丽女士，委员。现任中海基金管理有限公司研究部总经理、基金经理。

刘俊先生，委员。现任中海基金管理有限公司权益投资部权益投资副总监、基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。



### （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、编制报告、中期报告和年度报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，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。

#### (五) 基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉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、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

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。

#### (六) 基金管理人的风险管理和内部控制制度

##### 1、内部控制体系概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

##### 2、风险管理的理念和文化

(1) 以最大程度保护基金份额持有人利益为己任。

(2) 风险管理是业务发展的保障。

(3) 最高管理层承担最终责任。

(4) 分工明确、相互制约的组织结构是前提。

(5) 制度建设是基础。

(6) 制度执行监督是保障。

##### 3、内部控制遵循的原则

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

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、公司自有资产、其他资产的运作分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

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

#### 4、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险控制组织体系至少应包括以下几个层面：一、董事会负责控制公司整体运营风险；二、公司高级管理层负责公司内部风险控制的领导及政策决定；三、风险管理部负责对业务风险进行日常管理；四、各职能部门负责对各自业务活动中潜在的风险通过执行制度进行控制。

(1) 董事会对内部风险控制负最终的责任。

董事会通过控制公司治理结构风险、制定内部管理制度、完善有关议事规则及充分发挥独立董事的作用达到对基金投资风险的最终控制。

风险控制委员会是董事会下设的专门委员会，主要职责有：审议基金资产风险状况评价分析报告，审定公司的业务授权方案的合法性、合规性，负责协调处理突发性重大事件并界定业务风险损失责任人的责任，审议公司其他各项资产管理业务的风险状况评价分析报告。其通过批准公司的风险控制战略、制度、工作计划和风险报告，确保公司具备能控制其在经营管理活动中所能认识的所有风险的必要系统、运作制度和控制环境。

(2) 高级管理层承担的风险管理工作主要有：组建公司风险管理部门，贯彻落实公司各项风险管理政策，监督检查下属部门的风控工作，发现问题并及时采取补救措施，定期向董事会汇报公司风险管理情况。

(3) 风险管理部为公司风控会下设的日常风险管理执行部门，其主要职责为：直接承担对公司经营管理和基金投资过程中发生风险的预警和控制职能，对有关风险提出分析报告并直接向风险控制委员会汇报工作。其具体职能有：对基金投资运作风险评估；新业务风险评估；投资风险指标监控和

信用风险、流动性风险等的评估和监控等。

(4) 业务部门处于风险管理的前沿，是公司内部风险控制措施的具体执行部门，应该了解业务经营所承担的风险，所以业务部门应承担的职责是参与公司风险管理制度的制定和修改，严格遵守公司的各项制度和流程，并督导部门员工严格执行，保证开展业务的合法合规。

各部门、分支机构负责人是该部门、分支机构风险控制的第一责任人，必须定期检查本部门的风险控制情况和风险控制措施是否有效。

#### 5、监督机构的合规检查作用

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及时向审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵纪守法情况进行监督，保证公司为控制风险所制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

#### 6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

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

(2) 公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法

律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 公司健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司合法权益。

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

(5) 公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

a、 各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

b、 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

c、 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；

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

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

f、 授权控制贯穿于公司经营活动的始终，通过完善法人治理结构、明确各部门职能与授权范围来完成；

g、 公司建立完善的资产分离制度，基金财产与公司资产、不同基金的财产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算；

h、 公司建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离；

- i、 公司制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序；
- j、 公司维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统；
- k、 公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

#### 7、基金管理人关于内部控制的声明

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

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2020 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各

类客户提供个性化的托管服务。截至 2020 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1094 只。自 2003 年以来，本行连续十七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 73 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

##### 1、内部风险控制目标

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

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险



管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

### 4、内部风险控制措施实施

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

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

况提出内部控制措施，督促职能部门改进。

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

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

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

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

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

## 5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

制衡的组织结构。

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

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

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：黄乐军

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

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

##### （2）中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：刘承来

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：郑健

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

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

#### 2、代销机构：

##### （1）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

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

(2) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

客户服务电话：95599

(3) 中国银行股份有限公司

住所：北京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：刘连舸

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

客户服务电话：95566

(4) 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

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

客户服务电话：95533

(5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客户服务电话：95559

(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

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755—83199084

传真：0755-83195049

资产托管部信息披露负责人：张燕

客户服务电话：95555

(7)中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

客户服务电话：95558

(8)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：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：010-58560666

传真：010-57092611

联系人：王志刚

客户服务电话：95568

(9)平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系电话：(0755) 2219 7701

传真电话：021-50979507

联系人：高希泉

客户服务电话：95511-3

(10) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

电话：021-61616206，021-61162137

传真：021-63604196

联系人：虞谷云

客户服务电话：95528

(11) 温州银行股份有限公司

住所：温州市车站大道 196 号

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：叶建清

联系电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

客户服务电话：96699（浙江省内）、962699（上海地区）、0577-96699

（其他地区）

(12) 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：王者凡

电话：010-85238890

客户服务电话：95577

(13) 上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：施传荣

电话：（021）38576666

传真：（021）50105124

客户服务电话：（021）962999

(14) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

客户服务电话：95574

(15) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

(16) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

电话：010-83574507

传真：010-83574807



联系人：辛国政

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

(17)长江证券股份有限公司

住所：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：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

(18)海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553

(19)中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：95587/400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

(20)申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523 或 4008895523

(21) 湘财证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

客户服务电话：95351

(22) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

(23) 东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：江苏省苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-33396288

(24) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

电话：023-63786633

传真：023-63786212

联系人：张煜

客户服务电话：95355 、4008096096

(25) 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：贺青

电话：021-38676666

传真：021-38676666

联系人：钟伟镇

客户服务电话：400-888-8666/95521

(26) 广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555305

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

(27) 金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：王作义

电话：0755-83025693

传真：0755-83025625

联系人：刘萍

客户服务电话：95372

(28) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务电话：95565

(29) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客户服务电话：95531 或 400-888-8588

(30) 中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：许慧琳

客户服务电话：400-620-8888

(31) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

(32) 安信证券股份有限公司

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

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：黄炎勋

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：95517

(33) 光大证券股份有限公司

住所：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：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

(34) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：021-95503 或 4008-888-506

(35) 华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656、4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：400-689-8888

(36) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

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

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

(37) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

(38) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

(39) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：0755-23838750

传真：0755-82485081

客户服务电话：95358

(40) 万联证券股份有限公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：甘蕾

电话：020-37865070

联系人：王鑫

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

(41) 中国中金财富证券有限公司

住所：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 层-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 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：胡芷境

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

客服电话：95532

(42) 申万宏源西部证券有限公司

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

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

(43) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李飞

客户服务电话：400-8888-777

(44) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室



办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

(45) 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：武晋婧

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

(46) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

(47) 方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远中心 4、5 号楼

3701-3717

法定代表人：施华

联系人：丁敏

联系电话：010-59355997

传真：010-57398130

客户服务电话：95571

根据《方正证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司关于实施经纪业务及客户整体迁移合并的联合公告》，方正证券、民族证券定于 2019 年 5 月 24 日日终清算完成后，实施客户及业务整体迁移合并，将民族证券的客户及业务整体迁移合并入方正证券。

(48) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：王一通

客户服务电话：95548

(49) 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

客服热线：95360

邮编：130119

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

(50) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

(51) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：400-888-8993

(52) 华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-68778010

传真：021-68778117

客服电话：400-820-9898、021-38929908

(53) 长城国瑞证券有限公司

住所：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇

联系人：赵钦

客户服务电话：0592-5163588

(54) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客户服务电话：010-66045678

(55) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

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

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

联系电话：0532-89606165

客服电话：95548

(56) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）  
单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨丽娟

业务联系电话：021-64339000-807

客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918

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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

(58) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

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：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客户服务电话：95584 和 4008-888-818

(59) 中国国际金融股份有限公司

住所：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

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：01065051166

客服电话：4009101166

(60) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心

西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

传真：0752-2119660

客户服务电话：95564

(61) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

(62) 东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法人代表：张运勇

电话：0769-22115712、0769-22119348

传真：0769-22119423

联系人：李荣、孙旭

客户服务电话：95328

(63) 中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、  
20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

(64) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

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

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

(65) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：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物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

(66)上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

业务联系人：郑茵华

联系电话：021-20691831

客服电话：400-089-1289

(67)诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

联系人：余翼飞

联系电话：021-80358749

客服电话：400-821-5399

(68)和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：章知方

联系人：陈慧慧

联系电话：010-85657353

客服电话：400-920-0022/021-20835588

(69)上海天天基金销售有限公司

住所：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

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话：021-54509977

客服电话：400-1818-188

(70) 浦领基金销售有限公司

住所：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：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

(71) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

联系电话：021-20613999

客服电话：400-700-9665

(72) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

联系电话：021-50583533

传真：021-61101630

客服电话：400-921-7755

(73) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 号

法定代表人：罗细安



联系人：史丽丽

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

(74)北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

联系人：周斌

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

(75)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：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10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系电话：010-63130889-8369

客服电话：400-166-1188

(76)浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

(77)中期资产管理有限公司

住所：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号中期大厦8层

法定代表人：姜新

联系人：方艳美

联系电话：010-65807865

客服电话：010-65807865

(78) 上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

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

联系人：甄宝林

联系电话：021-34013996

客服电话：021-34013999

(79) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

(80) 北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

联系人：陈铭洲

联系电话：010-65951887

传真：010-65951887

客服电话：4000681176

(81) 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 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：高皓辉

联系电话：021-63333389

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

(82) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：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：邱湘湘

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

(83) 奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入住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：TEOWEEHOWE

联系人：叶健

联系电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

(84) 安粮期货股份有限公司

住所：安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层

办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层(总部)

法定代表人：朱中文

联系人：梁蕾

联系电话：0551-62870125

传真：0551-62870131

客服电话：4006269988

(85) 上海联泰基金销售有限公司

住所：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

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

(86) 北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

(87) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：翟文

客户服务电话：4008188000

(88) 深圳市金斧子基金销售有限公司

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

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

法定代表人：赖任军

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

联系人：刘昕霞

客户服务电话：400-930-0660

(89) 北京广源达信基金销售有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

电话：4006236060

传真：010-82055860

联系人：王英俊

客户服务电话：400-623-6060

(90) 上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客户服务电话：4006767523

(91) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

联系电话：18601207732

传真：010-82057741

客服电话：4000888080

(92) 深圳前海微众银行股份有限公司

住所：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沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座

法定代表人：顾敏

电话：0755-89462447

传真：0755-86700688

联系人：罗曦

客户服务电话：400-999-8877

(93) 上海基煜基金销售有限公司

住所：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：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

(94) 北京懒猫金融信息服务有限公司

住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

电话：010-57649619

传真：010-57649620

联系人：朱翔宇

客户服务电话：010-57649619

(95) 一路财富(北京)信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312877

联系人：徐越

客户服务电话：400-001-1566

(96) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

电话：025-66996699-887226

传真：025-66008800-887226

联系人：张慧

客户服务电话：95177

(97) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：吴季林

客户服务电话：4000618518

(98)上海景谷基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

法定代表人：袁飞

电话：61621602

传真：61621602\*819

联系人：袁振荣

客户服务电话：61621602

(99)北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：熊小满

客户服务电话：400-619-9059

(100)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122672

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客户服务电话：400-9180808

(101)北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块



新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

电话：010-62675768

传真：010-62676582

联系人：赵芯蕊

客户服务电话：010-62675369

(102) 天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-1 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服电话：400-111-0889

(103) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

住所：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

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

(104) 上海云湾基金销售有限公司

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：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：江辉

客户服务电话：400-820-1515

(105)南京途牛基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

联系人：张士帅

联系电话：025-86853969

客服电话：4007-999-999

(106)上海万得基金销售有限公司

住所：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

联系电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服电话：400-821-0203

(107)杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：张丽琼

联系电话：0571-85262700

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86915761

(108)北京植信基金销售有限公司

住所：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：杨纪锋

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：400-680-2123

(109)北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

电话：4000988511/4000888816

传真：010-89188000

客服电话：95118

(110)上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：浦东新区上丰路977号1幢B座812室

办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼

法定代表人：廖冰

联系人：郑秋月

联系电话：021-80234888-6694

传真：021-80234898

客服电话：4006991888

(111)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所：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

联系人：徐英

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

(112) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：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

客服电话：400-817-5666

(113) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客户服务电话：4000279899

(114) 和耕传承基金销售有限公司

住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

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六层

法定代表人：李淑慧

联系人：罗聪

客户服务电话：0371-85518396

(115) 徽商期货有限责任公司

住所：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

办公地址：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

法定代表人：吴国华

联系人：申倩倩

客户服务电话：4008878707

(116)北京微动利基金销售有限公司

住所：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：季长军

联系人：何鹏

客户服务电话：400-819-6665

(117)上海挖财基金销售有限公司

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

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

联系电话：021-50810687

客服电话：021-50810673

(118)上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

联系人：宋楠

联系电话：021-20219988

客服电话：021-20292031

(119)北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68292940

传真：010-68292964

客户服务电话：400-600-0030

(120)北京晟视天下基金销售有限公司

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 层&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：刘聪慧/徐晓荣

电话：010-58170905/010-58170876

传真：010-58100800

客户服务电话：400-818-8866

(121)北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

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：曹庆展

客户服务电话：400-066-8586

(122)万家财富基金销售(天津)有限公司

住所：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：邵玉磊

客户服务电话：010-59013825

(123)深圳前海财厚基金销售有限公司

住所：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

联系人：胡闻智

客户服务电话：400-128-6800

(124)腾安基金销售(深圳)有限公司

住所：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：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层

法定代表人：刘明军

联系人：谭广锋

客服电话：95017(拨通后转1再转8)

(125)西藏东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

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

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357

(126)玄元保险代理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谱

联系人：张藤藤

电话：18410119857

客服电话：400-080-8208

(127) 大连网金基金销售有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

联系人：李鑫

电话：13889695712

客服电话：4000-899-100

(128) 北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

联系人：孙博超

电话：010-61952703

客服电话：95055-4

(129) 泛华普益基金销售有限公司

住所：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

联系人：隋亚方

电话：1391018193618410119857

客服电话：400-080-3388

(130) 民商基金销售(上海)有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：郑经枢

联系电话：021-50206003

客服电话：021-50206003



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，并及时公告。

## （二）注册登记机构

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：黄乐军

总经理：黄乐军（代）

成立日期：2004 年 3 月 18 日

电话：021-38429808

传真：021-68419328

联系人：周琳

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

法定代表人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：秦悦民、王利民

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-58153000

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、蔺育化

## 六、基金的募集

### （一）募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关法律法规，并经中国证监会2010年1月7日证监许可[2010]20号文核准募集发售。

### （二）基金类型及基金存续期间

- 1、基金类型：股票型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金存续期间：不定期

### （三）募集方式

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

### （四）募集期限

自基金份额发售之日起，最长不超过3个月，具体发售时间以基金份额发售公告为准。

### （五）募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

### （六）募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### （七）募集目标

本基金不设定募集规模上限，基金管理人视募集情况可提前结束募集。

### （八）基金份额的认购

#### 1、基金份额初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1) 基金份额初始面值：本基金基金份额初始面值为 1.00 元人民币，按初始面值发售。

(2) 认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，如下所示：

(单位：元)

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.00%
100 万 ≤ M < 500 万	0.60%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.20%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

投资者重复认购，须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

(3) 认购份额的计算

本基金份额的初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

本基金认购采取金额认购方式，认购份额的计算包括认购金额和认购金额在本基金募集期间产生的利息，其中利息以注册登记机构的记录为准，保留小数点后两位。认购份额计算时采用四舍五入方法保留至小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

本基金有效认购申请的认购费用及认购份额的计算统一采用外扣法，计算公式如下：

基金的认购金额包括认购费用和净认购金额，其中：

(一) 净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)。

(二) 认购费用 = 认购金额 - 净认购金额，或，认购费用 = 固定认购费金额。

(三) 认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额初始面值。

## 2、认购的程序

(1) 认购时间安排

投资人认购本基金份额具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机

构确定，请参见本基金的基金份额发售公告。

(2) 投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

(3) 基金份额的认购采用金额认购方式

投资人认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资人在基金募集期内可多次认购，认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。投资人的认购申请一经受理不得撤销。

(4) 认购的确认

当日（T日）在规定时间内提交的申请，投资人通常可在T+2日到网点查询认购申请的受理结果，在基金合同生效后的2个工作日内可以到网点打印交易确认书。

(5) 认购金额的限制

通过本公司网站和代销机构首次认购单笔最低金额为人民币1000元；通过本公司直销机构首次认购单笔最低金额为人民币100,000元，追加认购单笔最低金额为人民币10,000元。投资人在募集期内可以多次认购基金份额。募集期间不设置投资人单个基金账户最高认购金额限制。

3、若基金合同生效，认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。认购利息折算的基金份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。认购利息折成基金份额不收取认购费、不受最低认购份额限制。

(九) 募集资金的管理

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金份额持有人不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

《基金合同》生效时，认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。基金募集期产生的利息以基金注册登记机构的记录为准。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

如果《基金合同》不能生效，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和基金资产净值

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净

值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购和赎回

### （一）申购与赎回场所

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。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在管理人网站公示。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购、赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对开放日和开放日的具体业务办理时间进行调整，但此项调整应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。
- 4、基金管理人可根据基金运作的实际情况依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。



#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间内向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《基金合同》和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金管理人或其委托的注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者应在 T+2 日后（包括该日）及时向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

### （五）申购与赎回的数额限制

1、通过销售机构首次申购单笔最低金额及追加金额为人民币 1 元，各销售机构对申购金额及交易级差有规定的，以各销售机构为准。通过本公司网上直销平台首次申购单笔最低金额为人民币 1 元；通过本公司直销柜台首次申购单笔最低金额为人民币 100,000 元，追加申购单笔最低金额为人民币 10,000 元。

2、投资人将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

3、投资人可多次申购，对单个投资人累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、投资人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔最低赎回份额为 1 份（除非该账户在销售机构或网点托管的基金份额余额不足 1 份）；若某笔赎回或转换导致持有人在销售机构或网点托管的基金份额余额少于 1 份，剩余部分基金份额必须一起赎回，即交易账户最低基金份额为 1 份。

5、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。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （六）申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担。

2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取。其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

### 3、申购费用

本基金申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。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，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户申购费率见下表：  
(单位：元)

购买金额 (M)	申购费率
M < 100 万	0.48%
100 万 ≤ M < 300 万	0.24%
300 万 ≤ M < 500 万	0.06%
M ≥ 500 万	按笔收取，1000 元/笔

非养老金客户申购本基金的申购费率见下表：

(单位：元)

购买金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.20%

100 万 $\leq$ M<300 万	0.80%
300 万 $\leq$ M<500 万	0.40%
M $\geq$ 500 万	按笔收取，1000 元/笔

#### 4、赎回费用

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定，赎回费率如下：

持有时间（N）	赎回费率
N<7 天	1.5%
7 天 $\leq$ N<365 天	0.5%
365 天 $\leq$ N<730 天	0.25%
N $\geq$ 730 天	0

5、本基金的赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

6、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和赎回费率，并另行公告。

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

8、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。

## （七）申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额，或，申购费用 = 固定申购费金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

### 2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

### 3、本基金基金份额净值的计算：

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### （八）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述注册登记办理时间进行调整，并于调整前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可以暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常运转。
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算。
- （3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或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。
- （4）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。
- （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）申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。
- （8）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请。

发生上述情形之一的，申购款项将相应退还投资者。发生上述（1）到（4）项及第（8）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）证券交易所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

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

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个申请赎回本基金的基金份额持有人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给申请赎回本基金的基金份额持有人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定媒介公告。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，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）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为支付基金份额持有人的赎回申请可能会对基金的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日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；基金份额持有人未能赎回部分，除基金份额持有人在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）



的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。

(4) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒介刊登公告。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；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，并在指定媒介公告。

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

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，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

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。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### (十三) 基金的转换

为方便基金份额持有人，本基金已于 2010 年 5 月 26 日起开通基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定详见基金转换公告。

#### (十四) 基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

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”指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的可持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

#### （十五）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个销售机构的交易账户转入另一个销售机构的交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### （十六）定期定额投资计划

本基金已于 2010 年 5 月 26 日开通定期定额申购业务，基金定投的数额限制、业务规则等请参见基金定投相关公告。

#### （十七）其他情形

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力争控制本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%，年跟踪误差不超过7.75%。在控制基金组合跟踪误差的前提下力争取得高于业绩基准的稳定收益，追求长期的资本增值。

### （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，包括上证 50 指数成份股及其备选成份股、新股、债券，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### （三）投资理念

采用增强型指数化投资的理念，以跟踪上证 50 指数为主，辅以适度增强的投资以追求对标的指数的适当超越，使投资者充分分享中国经济增长所带来的良好收益。

### （四）投资策略

本基金将采用“指数化投资为主、主动增强投资为辅”的投资策略，在完全复制标的指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本等因素造成的股票投资组合相对于标的指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。

## 1、资产配置策略

为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金将采用完全复制为主，增强投资为辅的方式，按标的指数的成份股权重构建被动组合，同时辅以主动增强投资，对基金投资组合进行适当调整，力争本基金投资目标的实现。

## 2、股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制方法进行构建，对于法律法规规定不能投资的股票将选择其它品种予以替代。主动投资主要采用自上而下与自下而上相结合的方法，依据宏微观研究与个股研究，在上证 50 指数中配置有正超额收益预期的成份股；同时，根据研究员的研究成果，适当的选择部分上证 50 指数成份股以外的股票作为增强股票库，构建主动型投资组合。

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

### （1）指数化投资

本基金指数化投资部分不低于基金资产的 80%，主要采用完全复制标的指数的被动投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重来被动构建股票投资组合，从而有效跟踪标的指数，控制跟踪误差。

### （2）主动增强投资

在指数化投资过程中，由于交易成本的存在，完全复制的被动投资策略可能很难有效跟踪标的指数。因此，本基金将采用适度的主动性投资策略对指数化投资进行修正，以求降低由于交易成本等因素导致的对标的指数跟踪的影响，并力争适度超越标的指数，获取超额收益。主动增强投资部分不超过基金资产的 15%。

#### 1) 在成份股内进行适度增强

本基金将在充分进行宏微观经济研究与个股深度研究的基础上，结合自上而下与自下而上两种策略对成份股进行多维度的深度研究，在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，将适度地配置价值低估或者成长性良好的蕴含正超额收益预期的成份股。

## 2) 对非成份股进行适度增强

本基金将基于投研团队充分的调研与全面的研究论证，进行以下三种具体操作：

a.合理替代部分流动性缺失的成份股。标的指数部分成份股可能因为长期停牌、被列入本公司禁止投资股票以及交易量不足等因素，使得本基金无法依照标的指数权重购买成份股。因此，本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票。本基金将首选与该成份股行业属性一致、相关性高的其他成份股进行替代；若成份股中没有符合要求的替代品种，本基金将在成份股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的股票作为替代品种。

b.前瞻性纳入部分备选成份股。如果预期标的指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股。

c.精选部分蕴含投资价值的非成份股。本基金管理人将采用数量化分析与基本面判断相结合的研究方法，在综合考虑跟踪偏离度、跟踪误差和投资者利益的基础上，决定适度买入部分具有增长潜力、蕴含投资价值的非成份股。

此外，本基金还将积极把握一级市场的新股申购与增发的盈利机会，以求提高资金运用效率。

## 3、债券投资策略

本基金将根据国际与国内宏微观经济形势、债券市场资金状况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期等进行综合分析，评定各债券品种的投资价值，同时着重考

考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

#### 4、投资组合调整策略

##### （1）投资组合调整原则

本基金为指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份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、新股增发等因素，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差最优化。

##### （2）投资组合调整方法

###### 1) 对标的指数的跟踪调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据上证 50 指数成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

###### 定期调整

根据上证 50 指数成份股定期调整结果，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

###### 不定期调整

当上证 50 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据上证 50 指数临时调整公告，基于本基金的投资组合调整原则，对投资组合进行相应调整。

###### 2) 限制性调整

###### 投资比例限制调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

###### 大额赎回调整

当发生大额赎回超过现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

#### （五）投资决策依据和程序

##### 1、投资决策依据：

- （1）国家有关法律、法规和本基金基金合同等的相关规定；
- （2）宏微观经济运行趋势和证券市场走势；
- （3）标的指数的编制方法及其变更。

##### 2、投资决策流程：

本基金投资决策流程主要包括：

- 投资决策委员会决定大类资产配置比例范围：投资决策委员会依据研究部策略分析师和投资决策委员会成员讨论后形成的一致意见，决定大类资产配置的范围。
- 基金经理依据投资决策委员会决议决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的投资策略和投资计划：中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理根据其本人对宏微观经济和大势的判断，在投资决策委员会决定的大类资产配置范围内，决定本基金的大类资产配置比例。
- 投资操作性方案的制定：基金经理依据金融工程部的数量化选股结合投研研究成果以及金融工程部提出的跟踪误差控制方案，决定指数复制部分、增强投资部分和债券投资部分的具体操作性方案。
- 合规性检查：基金经理的投资操作在日常工作中接受实时的合规性检查。
- 投资操作性方案的执行：基金经理在决定本基金的投资操作性方案后，在日常工作中进行下单交易。
- 风险实时监控：交易过程受风险控制部实时监控。
- 基金事务部清算：基金事务部负责基金的清算。

绩效评估与跟踪误差控制：金融工程部定期对本基金进行绩效评估和跟

踪误差计算，并分析跟踪误差产生的原因，当跟踪误差超过约定数值时，金融工程部提供降低跟踪误差的建议。

#### （六）投资限制

##### 1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

（2）本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；本基金指数化投资部分不受本条限制。

（3）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%。

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

（5）现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（6）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%。

（7）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%。

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

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



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

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

(12) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

(13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

除上述第(5)、(10)、(11)项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。

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

2、为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券。

(2) 向他人贷款或者提供担保。

(3) 从事承担无限责任的投资。

(4) 买卖其他基金份额,但法律法规另有规定的除外。

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

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

的证券。

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (七) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

上证50指数×95%+一年期银行定期存款利率（税后）×5%。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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

#### (八) 风险收益特征

本基金属指数增强型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高预期收益品种。

#### (九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### （十）基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

#### （十一）基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据为截至 2020 年 12 月 31 日报告期末的四季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

##### 1、基金资产组合情况

截至 2020 年 12 月 31 日，中海上证 50 指数增强型证券投资基金资产净值为 281,945,312.88 元，基金份额净值为 1.604 元，累计基金份额净值为 1.776 元。其资产组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	267,583,966.67	93.13
	其中：股票	267,583,966.67	93.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,695,045.50	5.46
	其中：债券	15,695,045.50	5.46
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,568,804.94	0.89
8	其他资产	1,488,388.96	0.52
9	合计	287,336,206.07	100.00

## 2、期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,193,687.40	1.49
C	制造业	92,543,426.10	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,967,038.00	1.41
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,928,174.30	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,443,056.50	2.64
J	金融业	132,309,911.38	46.93
K	房地产业	3,970,820.00	1.41
L	租赁和商务服务业	9,942,240.00	3.53
M	科学研究和技术服务业	5,698,656.00	2.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	262,997,009.68	93.28

### (2) 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,339,318.55	1.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,083,452.52	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	164,185.92	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,586,956.99	1.63

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### (1) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名

##### 股票投资明细

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,339,318.55	1.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,083,452.52	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	164,185.92	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,586,956.99	1.63

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688598	金博股份	6,403	1,384,840.84	0.49
2	688568	中科星图	11,020	483,778.00	0.17
3	688311	盟升电子	3,528	406,990.08	0.14
4	688063	派能科技	2,062	390,212.88	0.14
5	688065	凯赛生物	4,452	373,033.08	0.13

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,652,045.50	5.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	43,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,695,045.50	5.57

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	150,300	15,028,497.00	5.33
2	019610	18 国债 28	6,150	623,548.50	0.22
3	113616	韦尔转债	430	43,000.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

(3) 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1)

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

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 截止 2020 年 12 月 31 日，本基金的其他各项资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	38,615.01
2	应收证券清算款	690,721.51
3	应收股利	-
4	应收利息	332,654.87
5	应收申购款	426,397.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,488,388.96

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688568	中科星图	483,778.00	0.17	新股流通受限



2	688311	盟升电子	406,990.08	0.14	新股流通受限
3	688063	派能科技	390,212.88	0.14	新股流通受限
4	688065	凯赛生物	373,033.08	0.13	新股流通受限

(7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金业绩

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

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截止日期2020年12月31日)：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010.03.25- 2010.12.31	-14.30%	1.47%	-12.90%	1.54%	-1.40%	-0.07%
2011.01.01- 2011.12.31	-19.60%	1.22%	-17.15%	1.22%	-2.45%	0.00%
2012.01.01- 2012.12.31	9.00%	1.17%	14.33%	1.15%	-5.33%	0.02%
2013.01.01- 2013.12.31	-13.85%	1.52%	-14.28%	1.49%	0.43%	0.03%
2014.01.01- 2014.12.31	62.75%	1.34%	60.36%	1.35%	2.39%	-0.01%
2015.01.01- 2015.12.31	-2.28%	2.38%	-5.47%	2.41%	3.19%	-0.03%
2016.1.1-20 16.12.31	-5.64%	1.25%	-5.09%	1.21%	-0.55%	0.04%
2017.1.1-20 17.12.31	27.29%	0.67%	23.83%	0.66%	3.46%	0.01%
2018.1.1-20 18.12.31	-14.64%	1.29%	-18.78%	1.30%	4.14%	-0.01%

2019. 1. 1-20 19. 12. 31	43.18%	1.37%	31.89%	1.15%	11.29%	0.22%
2020. 1. 1-20 20. 12. 31	20.95%	1.53%	18.06%	1.32%	2.89%	0.21%
自基金合同 生效起至今	82.70%	1.43%	59.37%	1.40%	23.33%	0.03%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

#### （四）基金财产的处分

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

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

#### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

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

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

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他《基金合同》当事人承



承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的《基金合同》当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

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

(2) 差错的责任方对可能导致有关《基金合同》当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对受损方负责，不对第三方负责。

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

(6) 如果出现差错责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》的规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权对差错责任方进行追索，并

有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估。

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

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### (六) 暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金资产净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### （八）特殊情况的处理

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

## 十三、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

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于截至基金收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

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

#### （六）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，基金注册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。

## 十四、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费。
- 2、基金托管人的托管费。
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金的证券交易费用。
- 7、基金的银行汇划费用。
- 8、基金的指数使用费。
- 9、按照法律法规有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、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 0.85% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.85\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.17% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.17\% \div \text{当年天数}$$

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

### 3、 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，且收取下限为每季度（包括基金成立当季）人民币 5 万元。该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。计算方法如下：

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

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。

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

上述一、基金费用的种类中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

#### （四）费用调整

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

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》在指定媒介上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。



## 十五、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方。
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 3、基金的核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度。
- 5、本基金独立建账、独立核算。
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。
- 7、基金托管人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) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

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

### （一）信息披露义务人

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

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

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

### （二）本基金信息披露义务人信息披露承诺

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

### （三）本基金公开披露的信息应采用中文文本

如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证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。

### （四）信息披露的种类、披露时间和披露形式

公开披露的基金信息包括：

#### 1、《招募说明书》、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

（4）基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息

发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 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报刊和基金管理人网站上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和基金管理人网站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基金资产净值和基金份额净值。

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

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

## 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三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报

告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

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

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

## 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) 基金合同终止、基金清算。
- (3) 转换基金运作方式、基金合并。

(4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所。

(5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更。
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更。
- (8) 基金募集期延长。
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动。
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%，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 30%。
- (11) 涉及基金管理人业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁。
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查。
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外。
- (14) 基金收益分配事项。
- (15) 管理费、托管费、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 0.5%。
- (17) 本基金开始办理申购、赎回。
- (18) 本基金发生巨额赎回并延期办理。
- (19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
- (20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请。
- (21) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大

事项时。

(22) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值。

(23) 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，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 11、中国证监会规定的其他信息。

##### (五) 信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、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体披露信息，但是其他公共媒体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。

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

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

（七）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。



## 十七、风险揭示

基金风险按来源主要分为系统性风险、非系统性风险、基金管理风险和本基金特有风险。本基金本着科学、严谨的原则，对风险的识别、评估和控制的全过程进行管理。

### （一）市场风险

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

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

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

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。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，其收益水平会受到利率变化的影响。

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

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

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段

和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”章节。

#### 2、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括上证 50 指数成份股及其备选成份股、新股、债券，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。投资交易均在依法设立的正规市场中进行，所投市场和资产方面的整体流动性较高。同时，本基金通过投资限制对各类资产的投资比例、期限、评级、杠杆和集中度进行了控制，并严格控制了主动投资于流动性受限资产的比例上限。综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险可控，当发生极端市场情况时，基金管理人会按照相关法律法规及基金合同的规定，及时启动流动性风险应对措施，保护基金份额持有人的权益。

#### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- （1）延缓办理巨额赎回申请；
- （2）暂停接受赎回申请；
- （3）延缓支付赎回款项；

(4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见本招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

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

(1) 延期办理巨额赎回申请

具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

(2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

上述具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”的相关内容。

(3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

(4) 暂停基金估值

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

(5) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及自律组织规定。

当本基金出现上述情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### （四）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### （五）本基金特有的风险

作为一只增强型指数基金，本基金特有的风险主要包括被动跟踪指数的风险及主动增强投资的风险。

##### （1）被动跟踪指数的风险

主要表现在以下几方面：

1) 指数下跌风险：即在市场下跌的情况下由于本基金跟踪指数而对基金净值造成损失的不确定性；

2) 标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

3) 跟踪偏离风险及跟踪误差未达约定目标的风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，可能包括：

a) 基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出证券时均存在交易成本例如印花税、交易佣金、证管费、过户费等交易成本，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离；

b) 受市场流动性风险的影响本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为标的指数的成份股票、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将股票及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险；

c) 在本基金实行指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力例如

跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

#### 4) 指数编制机构停止服务的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

#### 5) 成份股停牌的风险

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

①基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

②停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

③在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款，由此基金管理人可能采取暂停赎回或延缓支付赎回款项的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### (2) 主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，本基金将在被动跟踪指数的基础上，基于基本面的深度研究适度买入部分具有增长潜力、蕴含投资价值的成份股和非成份股进行增强投资，但最终投资结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

#### (六) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金销售机构等机构

无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

### （七）投资科创板股票的特有风险

#### 1、市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

#### 2、流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### 3、退市风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板个股退市风险更大。

#### 4、集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

#### 5、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### 6、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来

较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人。
- （2）更换基金托管人。
- （3）转换基金运作方式。
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。
- （5）变更基金类别。
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）。
- （7）本基金与其他基金的合并。
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序。
- （9）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费。
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取。
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率。
- （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）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。



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

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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

## （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、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。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

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

- 1) 依法募集基金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律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、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《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) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- 13) 依照法律法规为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；
- 14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；

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

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

17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

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

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、勤勉尽责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内发出, 并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

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

者；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

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

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

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

7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的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, 保证基金财产的完整及不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

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

5) 保管由基金管理人代表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, 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) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

1) 分享基金财产收益；

2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；



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

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7) 监督基金管理人的投资运作；

8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

1) 遵守《基金合同》；

2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

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

6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止《基金合同》；

- 2) 更换基金管理人;
- 3) 更换基金托管人;
- 4) 转换基金运作方式;
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- 6) 变更基金类别;
- 7) 本基金与其他基金的合并;
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）;
- 9) 变更基金份额持有人大会程序;
- 10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 11) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- 1) 调低基金管理费、基金托管费;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
- 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) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，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、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

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

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面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书面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书面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。

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

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 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

金合同》和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

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

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

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

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

金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

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

## （2）议事程序

### 1) 现场开会

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

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

### 2) 通讯开会

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

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 7、计票

### （1）现场开会

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



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

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

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

## (2) 通讯开会

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

## 8、生效与公告

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

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 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。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

#### 1、基金收益分配原则

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于截至基金收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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。

#### 3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

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

#### 4、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，基金注册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）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）基金的指数使用费；

（9）按照法律法规有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

##### 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0.85%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.85\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工

作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.17% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.17\% \div \text{当年天数}$$

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

### （3）基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，且收取下限为每季度（包括基金成立当季）人民币 5 万元。该下限超出正常指数使用基点费的部分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。计算方法如下：

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

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。

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

上述 1、基金费用的种类中第（3）—（8）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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、费用调整

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

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施前按照《信息披露办法》在指定媒介上公告。

### 5、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。

## （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，包括上证 50 指数成份股及其备选成份股、新股、债券，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 2、投资限制

#### （1）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当

程序后可不受上述规定的限制。

(2) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；本基金指数化投资部分不受本条限制；

3) 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%；

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

5) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

6) 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%；

7) 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%；

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

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

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

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

12) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

除上述第 5)、10)、11) 项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、计算方法

本基金按以下方式进行估值:

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人计算的结果对外予以公布。

## 2、公告方式

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

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

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

## (七) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、《基金合同》的变更

(1) 以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- 1) 更换基金管理人；
- 2) 更换基金托管人；
- 3) 转换基金运作方式；
- 4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 5) 变更基金类别；
- 6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- 9) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 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) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

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

## 2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

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

#### 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）争议解决方式

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

《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、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一） 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：陈浩鸣

成立时间：2004 年 3 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]24 号文

注册资本：壹亿叁千万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

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

组织形式：股份有限公司

注册资金：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务

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

## （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

#### （1）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括上证 50 指数成份股及其备选成份股、新股、债券，以及中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种（如股指期货等），基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

本基金不得投资于相关法律法规及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

a、按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：



本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在根据下述第 3) 部分“基金比例调整期限”所规定的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

b、根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

b) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；本基金指数化投资部分不受本条限制；

c) 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%；

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

e) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

f) 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%；

g) 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%；

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

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

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

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

l) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

m) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

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

### 3) 基金投资比例调整期限

除上述第 e)、j)、k) 项另有规定外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应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。基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2

个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于基金托管人实施交易监督。

4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

5) 相关法律法规规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

1) 承销证券；

2) 向他人贷款或提供担保；

3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；

4) 买卖其他基金份额，但法律法规另有规定的除外；

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

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

7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于

基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

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

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

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

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

单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

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

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

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

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

(6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司和交通银行股份有限公司，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果

基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

#### (7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

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

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

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

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

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

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人已切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险或基金财产遭受损失,基金托管人应承担相应责任。

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

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

在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

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

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法

律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

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

## 2、基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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



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

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

### （三）基金财产保管

#### 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。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

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

#### 2、募集资金的验证

基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金

开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

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

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

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

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

### 5、债券托管帐户的开设和管理

(1) 《基金合同》生效后，基金管理人负责以本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，并代表本基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责本基金的债券的后台匹配及资金的清算。

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

#### 6、其他账户的开立和管理

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

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

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

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

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

管部门 15 年以上。

#### （四）基金资产净值计算和会计核算

##### 1、基金资产净值的计算

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

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金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工作日交易结束后计算当日的基金份额净值和基金份额累计净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的基金资产净值的计算结果对外予以公布。

##### 2、基金资产估值方法

###### （1）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产及负债。

## （2）估值方法

本基金的估值方法为：

### 1) 证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

### 2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

### 3、估值差错处理

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

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

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基

金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

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

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

#### 4、基金账册的建立

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

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

#### 5、基金定期报告的编制和复核

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

基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内

完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在一个月内完成中期报告，中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个月内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个半月内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

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

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

#### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金注册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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （六）争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改和终止

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后

的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

## 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

## 二十一、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金管理人将敦促基金注册登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；权益分配时红利的登记派发；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、每季度结束后20个工作日内，基金管理人将向该季度发生过交易的定制纸质对账单的投资者邮寄该季度对账单。每年度结束后30个工作日内，向所有定制纸质对账单的基金份额持有人寄送年度对账单。

4、对于未主动定制对账单服务的投资者，基金管理人将统一提供电子对账单（包含电子邮件或短信形式，按账户资料完善程度，优先提供电

子邮件对账单)。

### (三) 客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询、基金产品与传真服务等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天,每天不少于8小时的人工热线咨询服务。持有人可通过客服热线电话:400-888-9788或021-38789788享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### (四) 网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。个人投资者可以直接登录基金管理人网站www.zhfund.com办理“网上开户”和“网上交易”业务,适用银行卡详见基金管理人网站www.zhfund.com网上交易平台。

在技术条件成熟时,基金管理人还将提供支持其他银行卡种的网上交易业务。

### (五) 定期定额投资计划

本基金已于2010年5月26日开通定期定额申购业务,基金定投的数额限制、业务规则等请参见基金定投相关公告。

### (六) 信息定制服务

基金持有人可以登录基金管理人网站或拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定制提供信息。可定制的信息包括:电子对账单、每周基金净值、交易确认

信息、投资者服务刊物、分红公告、公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

#### （七）投资者投诉受理服务

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、基金管理人网站留言栏目、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉、网站留言是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务部负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的两个工作日之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务部邮箱：[service@zhfund.com](mailto:service@zhfund.com)

## 二十二、其他应披露的事项

1. 2020-6-30 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告
2. 2020-7-4 中海上证50指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第2号）
3. 2020-7-4 中海上证50指数增强型证券投资基金修订后基金合同
4. 2020-7-4 中海上证50指数增强型证券投资基金修订后托管协议
5. 2020-7-4 中海上证50指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2020年第2号）
6. 2020-7-21 中海上证50指数增强型证券投资基金2020年第2季度报告
7. 2020-7-29 中海基金管理有限公司关于旗下中海上证50指数增强型证券投资基金参与招商银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告
8. 2020-8-6 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告
9. 2020-8-14 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告
10. 2020-8-18 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东吴证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告
11. 2020-8-28 中海上证50指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）
12. 2020-8-28 中海上证50指数增强型证券投资基金2020年中期报告
13. 2020-9-17 中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠标准的公告
14. 2020-10-14 关于中海上证50指数增强型证券投资基金恢复大额申

- 购（含转换转入及定期定额投资）业务公告
15. 2020-10-22 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华鑫证券有限责任公司基金费率优惠活动的公告
  16. 2020-10-28 中海上证50指数增强型证券投资基金2020年第3季度报告
  17. 2020-11-10 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告
  18. 2020-12-18 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告
  19. 2020-12-21 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告
  20. 2020-12-24 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告
  21. 2020-12-25 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告
  22. 2020-12-30 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告
  23. 2021-1-4 中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司部分渠道申购费率和全渠道定投申购费率折扣标准的公告
  24. 2021-1-22 中海上证50指数增强型证券投资基金2020年第4季度报告
  25. 2021-1-26 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告
  26. 2021-3-11 中海基金管理有限公司关于华夏银行股份有限公司暂停本公司旗下部分基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告
  27. 2021-3-11 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告

28. 2021-3-12 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告



## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资人可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资人按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

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

## 二十四、标的指数的编制方法及指数信息查阅方式

### 一、标的指数编制方法

#### （一）样本空间

上证180指数样本股。

#### （二）选样方法

对样本空间内的股票按照最近一年总市值、成交金额进行综合排名，选取排名前50位的股票组成样本，但市场表现异常并经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外。

#### （三）指数计算

上证50指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本股的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\Sigma$ (股价 × 调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。

### 二、标的指数样本和权重调整

#### （一）定期调整

上证50指数每半年调整一次样本股，样本股调整实施时间分别为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。每次调整数量一般不超过10%，样本调整设置缓冲区，排名在前40名的候选新样本优先进入，排名在前60名的老样本优先保留。

#### （二）临时调整

特殊情况下将对上证50指数样本进行临时调整。对新发行股票的A股发行总市值（总市值=发行价×A股总股本）和沪市A股自该新发行股票上市公告日起过去一年的日均A股总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且A股发行总市值排名在沪市A股市场前10位的新发行A股股票，启用快速进入指数的规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入上证50指数，同时剔除上证50指数原样本中最近一年日均总市值、成交金额综合排名最末的股

票。

当样本股暂停上市或退市时，将其从指数样本中剔除。样本股公司发生收购、合并、分拆、停牌等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

### 三、标的指数信息查询途径

投资者可以直接登录中证指数有限公司的网站（<http://www.csindex.com.cn/>）免费查询标的指数的相关信息，包括指数概要、编制方法、指数行情、收益表现、临时变动、成份股列表等。

## 二十五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准中海上证50指数增强型证券投资基金募集的文件。
- 2、《中海上证50指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《中海上证50指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、关于申请募集中海上证50指数增强型证券投资基金法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### （三）查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

中海基金管理有限公司  
二〇二一年四月二十三日