

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

招募说明书(更新)

(2021年第4号)

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

国联安双力中小板综指分级证券投资基金的募集申请经中国证监会2011年10月9日证监许可[2011]1593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。国联安双力中小板综指分级证券投资基金由基金管理人依照《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的核准，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。

本基金为指数基金，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、成份券停牌等潜在风险，详见招募说明书“风险揭示”章节。本基金的标的指数为中小企业综合指数。

1、选样标准

在深圳证券交易所原中小企业板上市的全部股票。

2、计算方法

以指数样本股计算日股份数作为权数进行加权逐日连锁计算。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券信息有限公司网站，网址：<http://www.cnindex.com.cn/>。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩

并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2012年3月23日生效,根据基金合同的有关规定,国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金合同生效满三年后,本基金无需召开基金份额持有人大会,转换为上市开放式基金(LOF),即国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF),根据深圳证券交易所主板与中小板两板合并的安排,基金名称已变更为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”,基金代码为:“162510”。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2021年04月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2021年03月31日(财务数据未经审计)。

目 录

重要提示.....	1
一、绪言.....	5
二、释义.....	6
三、基金管理人.....	11
四、基金托管人.....	23
五、相关服务机构.....	26
六、基金的募集.....	54
七、基金的历史沿革.....	55
八、基金合同的生效.....	56
九、基金份额的申购与赎回.....	57
十、基金份额的上市交易.....	68
十一、基金份额的系统内转托管、跨系统转登记等其他相关业务.....	69
十二、基金的投资.....	71
十三、基金的业绩.....	82
十四、基金的财产.....	83
十五、基金资产的估值.....	84
十六、基金的收益与分配.....	89
十七、基金费用与税收.....	90
十八、基金的会计与审计.....	92
十九、基金的信息披露.....	93
二十、风险揭示.....	98
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	101
二十二、基金合同的内容摘要.....	104
二十三、基金托管协议的内容摘要.....	119
二十四、对基金份额持有人的服务.....	131
二十五、其他应披露事项.....	133
二十六、招募说明书的存放及查阅方式.....	134
二十七、备查文件.....	135

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规的规定,以及《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

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

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

二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF），由国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）更名而来，国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）由国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来

2. 基金管理人：指国联安基金管理有限公司

3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4. 基金合同：指《国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充

5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6. 招募说明书或本招募说明书：指《国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期的更新

7. 基金份额发售公告：指《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金份额发售公告》

8. 上市交易公告书：指《国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）上市交易公告书》

9. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10. 《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11. 《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12. 《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13. 《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14. 《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出

的修订

15. 《指数基金指引》：指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

18. 上市交易所：指深圳证券交易所

19. 中小企业综合指数：中小企业综合指数由中小板综合指数更名而来，中小板综合指数于2005年12月1日正式发布，覆盖了深圳证券交易所原中小企业板上市的全部股票，以综合反映深圳证券交易所上市的中小企业公司的整体状况

20. 转换日：指分级运作期到期日。本基金在分级运作期到期日日终，按照基金合同在分级运作期内的收益分配约定分别对双力A份额和双力B份额计算分级运作期到期日基金份额净值，并按照各自的份额净值转换为场内的双力中小板份额，转换完成后，本基金将更名为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）

21. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

22. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

23. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

24. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

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

26. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

27. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

28. 销售机构：指直销机构和代销机构

29. 直销机构：指国联安基金管理有限公司

30. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金

代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

31. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

32. 场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的认购、申购和赎回等业务的场所

33. 场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、上市交易、申购和赎回等业务的场所

34. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

35. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为国联安基金管理有限公司或接受国联安基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

36. 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

37. 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

38. 场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

39. 场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

40. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

41. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

42. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

43. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

44. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

45. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
46. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
47. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
48. T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
49. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
50. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
51. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
52. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
53. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
54. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
55. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，转托管包括系统内转托管和跨系统转登记
56. 系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为
57. 跨系统转登记：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为
58. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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人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
59. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%
60. 上市交易：指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

61. 元：指人民币元

62. 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

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

64. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

65. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

66. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

67. 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

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

69. 不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

法定代表人：于业明

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5亿元人民币

存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：021-38992888

传真：021-50151880

联系人：黄娜娜

股权结构：

股东名称	持股比例
太平洋资产管理有限责任公司	51%
德国安联集团	49%

(二) 主要成员情况

1、董事会成员

于业明先生，董事长，经济学博士，高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长，华宝信托投资有限责任公司总经理，联合证券有限责任公司总经理，华宝信托有限责任公司董事长，华宝投资有限公司总经理，华宝证券有限责任公司董事长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事，太平洋资产管理有限责任公司董事、党委副书记，太保产险董事，太保寿险董事，太平洋资产管理有限责任公司总经理等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长，国联安基金管理有限公司董事长。

Jiachen Fu（付佳晨）女士，副董事长，德国洪堡大学工商管理学士。历任美国克赖斯勒汽车集团市场推广及销售部学员、戴姆勒东北亚投资有限公司金融及监

控部成员、忠利保险公司内部顾问、安联全球车险驻中国业务发展主管兼创始人、安联集团董事会事务主任等职。现任安联资产管理公司管理董事兼中国业务发展总监、国联安基金管理有限公司副董事长。

杨一君先生，董事，工商管理硕士。历任美国通用再保险金融产品公司副总裁助理、中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心副总经理，太平洋资产管理有限责任公司运营总监、风险管理部总经理、合规审计部总经理、总经理助理等职。现任太平洋资产管理有限责任公司副总经理、合规负责人、首席风险管理执行官。

Anna Sophie Herken女士，董事，剑桥大学工商管理硕士、美利坚大学法学硕士。历任世界银行监察组顾问、柏林上诉法院书记员、柏林联邦经济技术部政务主任、世界银行监察组助理执行秘书长、欧洲复兴开发银行秘书长办公室首席顾问、柏林赫尔梯行政学院董事总经理、德国哈索·普拉特纳资本有限公司首席财务官、首席运营官及授权代表等职。现任安联资产管理有限公司业务部门主管。

王琤女士，董事，工商管理硕士。历任中国太平洋保险公司资金运用部处长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心综合业务处处长，太平洋资产管理有限责任公司市场营销部副总经理兼综合管理部副总经理、市场营销部总经理、固定收益部总经理，太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、首席风险管理执行官、合规负责人。现任国联安基金管理有限公司总经理。

陈有安先生，独立董事，工学博士。2016年4月退休前，历任国家开发银行华东地区信贷局副局长，国开行兰州分行行长、党委书记，甘肃省省长助理、党组成员，甘肃省省长助理兼贸易经济合作厅厅长、党组书记，甘肃省商务厅厅长、党组书记，甘肃省农村信用社联合社理事长、党委书记，中央汇金投资公司副总经理，中国银河金融控股公司董事长、党委书记，中国银河证券董事长、党委书记等职。

岳志明先生，独立董事，美国哥伦比亚大学工商管理硕士。历任野村证券国际金融部中国部负责人，野村国际（香港）中国投行部总经理、野村中国区首席执行官，美国华平投资集团董事总经理、全球合伙人等职。现任正大光明集团有限公司首席投资官。

胡斌先生，独立董事，特许金融分析师(CFA)，美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理公司Standish Mellon量化分析师、公司副总裁，Coefficient Global公司创始人之一

兼基金经理、梅隆资产管理中国区负责人、纽银梅隆西部基金管理有限公司首席执行官(总经理)等职。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)总经理。

2、监事

段黎明先生，监事会主席，会计专业硕士、工商管理硕士。历任平安电子商务有限公司财务分析主管、中国平安保险(集团)股份有限公司财务企划部项目负责人、平安集团财务上海分部预算管理室主任、财务管理室主任，平安资产管理有限责任公司财务部负责人、首席财务官等职。现任太平洋资产管理有限责任公司财务部总经理。

Uwe Michel先生，监事，法律硕士。历任慕尼黑Allianz SE亚洲业务部主管、主席办公室主管、Allianz Life Insurance Japan Ltd. 主席及日本全国主管、德国慕尼黑Group OPEX安联集团内部顾问主管等职。现任慕尼黑Allianz SE业务部H5投资与亚洲主管。

刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司运营部副总监。

朱敏菲女士，职工监事，大学本科，现任国联安基金管理有限公司人力综合部资深行政经理。

3、高级管理人员

于业明先生，董事长，经济学博士，高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长，华宝信托投资有限责任公司总经理，联合证券有限责任公司总经理，华宝信托有限责任公司董事长，华宝投资有限责任公司总经理，华宝证券有限责任公司董事长，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事，太平洋资产管理有限责任公司董事、党委副书记，太保产险董事，太保寿险董事，太平洋资产管理有限责任公司总经理等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长，国联安基金管理有限公司董事长。

王琤女士，总经理，工商管理硕士。历任中国太平洋保险公司资金运用部处长，中国太平洋保险(集团)股份有限公司资金运用管理中心综合业务处处长，太平洋资产管理有限责任公司市场营销部副总经理兼综合管理部副总经理、市场营销部总经理、固定收益部总经理，太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、首席风险管理执行官、合规负责人。现任国联安基金管理有限公司总经理。

魏东先生，常务副总经理，首席投资官，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；历任华宝兴业基金管理有限公司交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监、国内投资部总经理、国联安基金管理有限公司基金经理、总经理助理、投资总监等职。现任国联安基金管理有限公司常务副总经理并兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金和国联安核心资产策略混合型证券投资基金的基金经理。

蔡蓓蕾女士，副总经理，首席市场官，经济学博士。历任富国基金管理有限公司产品与营销部副总经理兼零售部副总经理、交银施罗德基金管理有限公司产品总监、泰康资产管理公司公募事业部市场业务负责人等职。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

李华先生，督察长，经济学硕士。历任北京大学经济管理系讲师、广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估有限公司董事长、天一证券有限公司华南业务总部总经理、融通基金管理有限公司监察稽核部总监及监事、新疆前海联合基金管理有限公司督察长等职。现任国联安基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

黄欣先生，硕士研究生。2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010年4月起担任国联安中证100指数证券投资基金（LOF）（2020年12月4日由国联安双禧中证100指数分级证券投资基金更名而来）的基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2013年6月至2017年3月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理，2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF）（2021年4月6日由国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）更名而来）的基金经理，2018年3月至2019年7月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年5月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019年6月起兼任国联安中

证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019年11月起兼任国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019年12月起兼任国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2021年2月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

(2) 历任基金经理情况

基金经理	担任本基金基金经理时间
冒浩	2018年06月至2019年07月

5、基金投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、权益投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人及高级基金经理组成。投资决策委员会成员为：

权益投资决策委员会成员为：

王琤（总经理）

魏东（投资总监、常务副总经理）权益投委会主席

邹新进（权益投资部总经理）

杨子江（研究部副总经理）

刘斌（权益投资部副总监、基金经理）

潘明（权益投资部总监、基金经理）

固定收益投资决策委员会成员为：

王琤（总经理）

魏东（投资总监、常务副总经理）固收投委会主席

万莉（现金管理部总经理、固定收益部代理负责人、基金经理）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人的职责

基金管理人的权利包括但不限于：

1、依法募集资金；

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

3、依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的

其他费用；

- 4、销售基金份额；
- 5、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6、依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8、选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9、担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10、依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- 11、在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- 14、以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 15、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 16、在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
- 17、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

基金管理人的义务包括但不限于：

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，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，但因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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；

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

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（四）基金管理人的承诺

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

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

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

(五) 基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

3、不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六) 基金管理人风险控制体系

基金管理人内部控制制度包括内部控制机制和内部控制制度两个方面。内部控制机制是指公司的内部组织结构及其相互之间的运行制约关系；内部控制制度是指公司为防范金融风险，保护资产的安全与完整，促进各项经营活动的有效实施而制定的各种业务操作程序、管理方法与控制措施的总称。

1、内部控制的目标

本基金管理人内部控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理公司。具体来说，必须达到以下目标：

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规、行业监管规则和自律规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、内部控制机制的原则

公司完善内部控制机制必须遵循以下原则：

(1) 健全性原则。内部控制应当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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

3、制订内部控制制度必须遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制的基本要求

(1) 必须依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

1) 建立以一线岗位为基础的第一道监控防线。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。

2) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。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。

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

(2) 必须建立科学的授权批准制度和岗位分离制度。各业务部门和分支机构必须在适当的授权基础上实行恰当的责任分离制度，直接的操作部门或经办人员和

直接的管理部门或控制人员必须相互独立、相互牵制。

(3) 必须建立完善的岗位责任制度和规范的岗位管理措施。在明确不同岗位的工作任务基础上,赋予各岗位相应的责任和职权,建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制度、严格的操作程序和合理的工作标准,大力推行各岗位、各部门、各机构的目标管理。

(4) 必须真实、全面地记载每一笔业务,充分发挥会计的核算和监督职能,健全会计、统计、业务等各种信息资料及时、准确报送制度,确保各种信息资料的真实与完整。

(5) 必须建立严密有效的风险管理系统,包括主要业务的风险评估和监测办法、分支机构和重要部门的风险考核指标体系以及管理人员的道德风险防范系统等。通过严密的风险管理,及时发现内部控制的弱点,以便堵塞漏洞、消除隐患。

(6) 必须制订切实有效的应急应变措施,设定具体的应急应变步骤。尤其是投资交易等重要区域遇到断电、失火等非常情况时,应急应变措施要及时到位,并按预定功能发挥作用,以确保公司的正常经营不会受到不必要的影响。

5、内部风险控制的内容

基金管理人内部风险控制的主要内容包括:投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、监察稽核控制等。

(1) 自觉遵守国家有关法律法规,按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册,明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 按照法律、法规和中国证监会有关规定,建立完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(3) 根据国家法律法规的要求,遵循安全性、实用性、可操作性原则,严格制定信息系统的管理制度。

(4) 依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(5) 按照法律法规和中国证监会有关规定,建立完善的监察稽核控制制度,保证监察稽核部门的独立性和权威性。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

- (1) 本基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任;
- (2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;
- (3) 本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和基金管理人不断发展完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：李莉

联系电话：(021)60637111

2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户处、托管应用系统支持处、合规监督处等12个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2020年二季度末，中国建设银行已托管1000只证

券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年及2019年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

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

3、内部控制制度及措施

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

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

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

送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

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

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

五、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、场外销售机构

1. 直销机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

法定代表人：于业明

客服电话：021-38784766，400-700-0365（免长途话费）

联系人：黄娜娜

网址：www.cpicfunds.com

2. 其他销售机构

(1) 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

法定代表人：陈四清

电话：010-66108011

联系人：吴于思

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(2) 名称：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：田国立

电话：010-67596233

联系人：王未雨

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 名称：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：郑杨

电话：021-61614934

联系人：周志杰

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(4) 名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87011947

联系人：朱海亚

客服电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

(5) 名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

电话：0755-22168301

联系人：汤俊劼

客服电话：95511

网址：www.bank.pingan.com

(6) 名称：东莞银行股份有限公司

住所：东莞市莞城区体育路21号

办公地址：东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：卢国锋

电话：0769-22865177

联系人：朱杰霞

客服电话：956033

网址: www.dongguanbank.cn

(7) 名称: 交通银行股份有限公司

住所: 中国 (上海) 自由贸易试验区银城中路188号

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人: 任德奇

电话: 021-58781234

联系人: 高天

客服电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(8) 名称: 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: 高迎欣

电话: 010-56367133

联系人: 王志刚

客服电话: 95568

网址: www.cmbc.com.cn

(9) 名称: 中信证券 (山东) 有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路28号龙翔广场1号楼东5层

法定代表人: 姜晓林

电话: 0532-85022026

联系人: 孙秋月

客服电话: 95548

网址: <http://sd.citics.com>

(10) 名称: 国泰君安证券股份有限公司

住所: 中国 (上海) 自由贸易试验区商城路618号

办公地址: 上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人: 贺青

电话: 021-38676666

联系人：钟伟镇

客服电话：95521，400-888-8666

网址：www.gtja.com

(11) 名称：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35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层

法定代表人：黄炎勋

电话：0755-82558266

联系人：彭洁联

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

(12) 名称：广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

法定代表人：孙树明

电话：0755-82558305

联系人：黄岚

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(13) 名称：山西证券股份有限公司

住所：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼29层

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686602

联系人：孟婉婷

客服电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

(14) 名称：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

电话：010-85156398

联系人：许梦园

客服电话：400-8888-108，95587

网址：www.csc108.com

(15) 名称：新时代证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：林雯

电话：010-83561146

联系人：田芳芳

客服电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

(16) 名称：东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层—29层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号新源广场2号楼21-29楼

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888-3108

联系人：吴宇

客服电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(17) 名称：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：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：张伟

电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(18) 名称：光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：刘秋明

电话：021-22169089

联系人：李晓哲

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

(19) 名称：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：周杰

电话：021-23219275

联系人：凌方睿

客服电话：95553

网址：www.htsec.com.cn

(20) 名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑军

电话：010-60834768

联系人：杜杰

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(21) 名称：中国中金财富证券有限公司

住所：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层
01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23单元

办公地址：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第
04层01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23单元

法定代表人：高涛

电话：0755-82026907

联系人：万玉琳

客服电话：400-6008-008, 95532

网址：www.china-invs.cn

(22) 名称：爱建证券有限责任公司

住所：上海市世纪大道1600号32楼

办公地址：上海市世纪大道1600号32楼

法定代表人：祝健

电话：021-62171984

联系人：陈敏

客服电话：021-63340678

网址：www.ajzq.com

(23) 名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市红岭中路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：0755-82133066

联系人：李颖

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(24) 名称：华宝证券有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人：刘加海

电话：021-68778081

联系人：胡星熠

客服电话：400-8209-898

网址：www.cnhbstock.com

(25) 名称：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：祝瑞敏

电话：010-83252185

联系人：付婷

客服电话：400-8008-899

网址：www.cindasc.com

(26) 名称：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：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

电话：010-80928123

联系人：辛国政

客服电话：95551, 400-8888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(27) 名称：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：0755-82960167

联系人：黄婵君

客服电话：95565, 400-8888-111

网址：www.newone.com.cn

(28) 名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

法定代表人：李峰

电话：021-20315137

联系人：许曼华

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(29) 名称: 东海证券股份有限公司

住所: 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: 021-20333910

联系人: 王一彦

客服电话: 95531

网址: www.longone.com.cn

(30) 名称: 华福证券有限责任公司

住所: 福州五四路新天地大厦7至10层

办公地址: 福州五四路新天地大厦7至10层

法定代表人: 黄金琳

电话: 0591-87383623

联系人: 张腾

客服电话: 400-8896-326

网址: www.gfhfzq.com.cn

(31) 名称: 华龙证券股份有限公司

住所: 甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼

办公地址: 甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人: 陈牧原

电话: 0931-4890100

联系人: 李昕田

客服电话: 96668 (甘肃省内), 400-6898-888

网址: www.hlzqgs.com

(32) 名称: 国金证券股份有限公司

住所: 成都市青羊区东城根上街95号

办公地址: 成都市东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人: 冉云

电话: 028-86692603

联系人: 陈瑀琦

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

(33) 名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

法定代表人：何之江

电话：0755-22626391

联系人：郑舒丽

客服电话：95511

网址：www.stock.pingan.com

(34) 名称：中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

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

法定代表人：丛中

电话：010-59562532

联系人：马琳瑶

客服电话：95335

网址：www.scstock.com

(35) 名称：东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

(36) 名称：长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

电话：027-65799999

联系人：李良

客服电话：95579

网址：www.95579.com

(37) 名称：华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层

法定代表人：张海文

电话：010-58566100

联系人：李慧灵

客服电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

(38) 名称：天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

电话：027-87618882

联系人：翟璟

客服电话：95330

网址：www.tfzq.com

(39) 名称：江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-85863726

联系人：周俊

客服电话：956007

网址：www.jhzq.com.cn

(40) 名称：西南证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：廖庆轩

电话：023-63786464

联系人：陈诚

客服电话：95355

网址：www.swsc.com.cn

(41) 名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

联系人：陆晓

客服电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

(42) 名称：红塔证券股份有限公司

住所：云南昆明市北京路155号附1号

办公地址：云南昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11层

法定代表人：李素明

电话：0871-63577946

联系人：高国泽

客服电话：400-871-8880

网址：www.hongtastock.com

(43) 名称：西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

联系电话：029-87406171

联系人：王宝辉

客服电话：95582

网址: www.west95582.com

(44) 名称: 国元证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市梅山路18号

办公地址: 安徽省合肥市梅山路18号

法定代表人: 俞仕新

联系电话: 0551-2257034

联系人: 李伟卫

客服电话: 95578

网址: www.gyzq.com.cn

(45) 名称: 中山证券有限责任公司

住所: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人: 吴小静

电话: 0755-82570586

联系人: 罗艺琳

客服电话: 95329

网址: www.zszq.com

(46) 名称: 第一创业证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼

法定代表人: 刘学民

电话: 0755-23838750

联系人: 单晶

客服电话: 95358

网址: www.firstcapital.com.cn

(47) 名称: 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

法定代表人: 丁学东

联系人: 杨涵宇

电话：010-65051166

客服电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

(48) 名称：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：杨玉成

电话：021-33388254

联系人：施磊

客服电话：95523，400-889-5523

网址：www.swhysc.com

(49) 名称：万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

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：罗钦城

电话：020-38286026

联系人：吕祥奎

客服电话：95322

网址：www.wlzq.com.cn

(50) 名称：德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：武晓春

电话：021-68761616

联系人：刘熠

客服电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

(51) 名称：中信期货有限公司

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

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、14层

法定代表人：张皓

电话：021-60833754

联系人：刘宏莹

客服电话：400-990-8826

网址：<http://www.citicsf.cn>

（52）名称：华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161821

联系人：孙懿

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

（53）名称：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：张昱

电话：010-59497361

联系人：李艳

客服电话：400-012-5899

网址：www.zscffund.com

（54）名称：北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号安联大厦10层

法定代表人：张冠宇

电话：010-85932871

联系人：孙书慧

客服电话：400-819-9868

网址: www.tdyhfund.com

(55) 名称: 凤凰金信(海口)基金销售有限公司

住所: 海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园E区4层

办公地址: 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层
1402(750000)

法定代表人: 张旭

电话: 010-58160168

联系人: 陈旭

客服电话: 400-810-5919

网址: www.fengfd.com

(56) 名称: 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室

办公地址: 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人: 林义相

电话: 010-66045678

联系人: 谭磊

客服电话: 010-66045555

网址: www.txsec.com

(57) 名称: 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: 上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室

法定代表人: 杨文斌

电话: 021-36696312

联系人: 高源

客服电话: 400-700-9665

传真: 021-68596919

网址: www.ehowbuy.com

(58) 名称: 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号楼二层

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

电话：021-54509977

联系人：朱玉

客服电话：400-181-8188

网址：www.1234567.com.cn

(59) 名称：北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

联系人：李晓芳

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

(60) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座17楼

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：400-076-6123

公司网址：www.fund123.cn

(61) 名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室

办公地址：广东省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

电话：0755-33227950

联系人：童彩平

客服电话：400-678-8887

网址：www.zlfund.cn

(62) 名称：和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

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

电话：010-85650039

联系人：刘洋

客服电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

(63) 名称：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号陆家嘴金融服务广场二期11层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

联系人：胡雪芹

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(64) 名称：北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区德胜门外大街83号4层407

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦12层1208号

法定代表人：罗细安

电话：010-67000988

联系人：李皓

客服电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

(65) 名称：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53层

法定代表人：李兴春

电话：021-50585353

联系人：陈孜明

客服电话：400-032-5885

网址：www.leadfund.com.cn

(66) 名称: 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1号元茂大厦903室

办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人: 吴强

电话: 0571-88911818

联系人: 吴强

客服电话: 400-877-3772

网址: www.5ifund.com

(67) 名称: 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所: 深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人: 洪弘

电话: 010-83363101

联系人: 文雯

客服电话: 400-166-1188

网址: <http://8.jrj.com.cn>

(68) 名称: 上海陆金所基金销售有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区源深路1088号7层(实际楼层6层)

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼

法定代表人: 陈祎彬

电话: 021-20665952

联系人: 宁博宇

客服电话: 400-821-9031

网址: www.lufunds.com

(69) 名称: 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号楼3层

法定代表人: 尹彬彬

电话: 021-62680166

联系人: 兰敏

客服电话: 4001181188

网址: www.66liantai.com

(70) 名称: 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 (集中办公区)

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

电话: 020-89629099

联系人: 邱湘湘

客服电话: 020-89629066

网址: www.yingmi.cn

(71) 名称: 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 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人: TEO WEE HOWE

联系人: 叶健

电话: 0755-89460507, 0755-89460500

客服电话: 400-684-0500

网址: www.ifastps.com.cn

(72) 名称: 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: 广东省深圳市南山区科苑路16号东方科技大厦18楼

法定代表人: 赖任军

电话: 0755-84034499

联系人: 张烨

客服电话: 400-930-2888

网址: www.jfzinv.com

(73) 名称: 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所: 武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室

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

电话：027-83863742

联系人：陆锋

客服电话：400-027-9899

网址：www.buyfunds.cn

（74）名称：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：中国（上海）浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：黄伟

电话：021-50712782

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

（75）名称：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3层342

办公地址：北京市石景山区古城西路113号3层341-342室

法定代表人：季长军

电话：010-52609656

联系人：季长军

客服电话：400-188-5687

网址：www.buyforyou.com.cn

（76）名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼17层19C13

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室

法定代表人：王伟刚

电话：010-62680527

联系人：丁向坤

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

(77) 名称: 北京晟视天下基金销售有限公司

住所: 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

法定代表人: 蒋煜

电话: 400-818-8866

联系人: 徐晓荣, 刘聪慧

客服电话: 010-58170761

网址: www.shengshiview.com.cn

(78) 名称: 上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

办公地址: 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人: 王翔

电话: 021-65370077

联系人: 吴鸿飞

客服电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

(79) 名称: 北京蛋卷基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

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

联系人: 戚晓强

客服电话: 400-061-8518

网址: <https://danjuanapp.com>

(80) 名称: 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759号18层03单元

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

法定代表人: 胡燕亮

电话: 010-62680827

联系人: 樊晴晴

客服电话:021-50810673

网址: www.wacaijijin.com

(81) 名称: 济安财富(北京)基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人: 杨健

电话: 010-65309516

联系人: 李海燕

客服电话: 400-673-7010

网址: www.jianfortune.com

(82) 名称: 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人: 王苏宁

电话: 13810801527

联系人: 韩锦星

客服电话:400-088-8816

网址: kenterui.jd.com

(83) 名称: 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

电话: 021-61912426

联系人: 杨一新

客服电话: 021-50206003

网址: www.msftec.com

(84) 名称: 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

电话: 010-88066326

联系人: 仲秋玥

客服电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(85) 名称: 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

电话: 021-80358236

联系人: 李娟

客服电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(86) 名称: 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

电话: 021-20219988-35328

联系人: 宋楠

客服电话: 021-20292031

网址: www.wg.com.cn

(87) 名称: 通华财富(上海)基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址: 上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层

法定代表人: 沈丹义

电话: 021-60818588

联系人: 卞仪伟

客服电话: 400-101-9301

网址: www.tonghuafund.com

(88) 名称: 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(100031)

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336544

联系人：沈晨

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

(89) 名称：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号

法定代表人：刘汉青

电话：025-66996699-887226

联系人：王锋

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

(90) 名称：江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

电话：025-66046166-810

联系人：林伊灵

客服电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

(91) 名称：北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼（度小满金融总部）1层

法定代表人：葛新

联系人：孙博超

电话：010-59403028

客服电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

(92) 名称: 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

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

法定代表人: 樊怀东

电话: 18201076782

联系人: 贾文哲

客服电话: 400-088-9100

网址: www.yibaijin.com

(93) 名称: 中国人寿股份有限公司

注册地址: 中国北京市西城区金融大街16号

办公地址: 中国北京市西城区金融大街16号

法定代表人: 杨明生

电话: (010) 63631519

联系人: 陈慧

客户服务热线: 95519

网站: www.e-chinalife.com

(94) 名称: 北京创金启富基金销售有限公司

住所: 北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

法定代表人: 梁蓉

客服电话: 010-66154828

网址: www.5irich.com

(95) 名称: 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号东方财富大厦

法定代表人: 郑立坤

电话: 021-23586603

联系人: 付佳

客服电话: 95357

网址: <http://www.18.cn>

(96) 名称: 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

联系人: 罗曦

客服电话: 400-999-8800

网址: www.webank.com

(97) 名称: 北京虹点基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室

办公地址: 北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门二层

法定代表人: 何静

电话: 010-85643600

联系人: 牛亚楠

客服电话: 400-618-0707

网址: www.hongdianfund.com

2、场内销售机构

本基金的场内销售机构为基金管理人直销机构和具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位, 具体销售机构名单详见深圳证券交易所网站。

(二) 登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京市西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址: 北京市西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人: 金颖

电话: 010-58598835

传真: 010-58598907

联系人: 任瑞新

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

联系人：陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬，陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦5楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

首席合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：潘晓怡

经办会计师：张炯，潘晓怡

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。并于2011年10月9日经中国证监会证监许可[2011]1593号文核准募集。募集期为2012年2月20日至2012年3月16日。经毕马威华振会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期共募集809,109,186.27份基金份额，有效认购户数为5,177户。

七、基金的历史沿革

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)由国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名而来,国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)由国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来。

国联安双力中小板综指分级证券投资基金经中国证监会2011年10月9日证监许可[2011]1593号文核准。《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》于2012年3月23日正式生效。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的约定,自2015年3月24日起,国联安双力中小板综指分级证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF),名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”;自2021年4月6日起,根据深圳证券交易所主板与中小板两板合并统一安排,名称变更为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”,即本基金。

八、基金合同的生效

(一) 基金合同生效

本基金合同已于2012年3月23日生效。

(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定的，按其规定办理。

九、基金份额的申购与赎回

本基金《基金合同》生效后，投资者可通过场外或场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。

（一）申购和赎回场所

基金份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。基金份额场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

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，并予以公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1. 开放日及开放时间

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

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

2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金份额的申购开始日：2012年4月16日

本基金份额的赎回开始日：2012年4月16日

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 场外赎回遵循“先进先出”原则，即场外赎回按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4. 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。

场内基金份额的申购、赎回应遵循证券交易所及注册登记机构的相关业务规则。基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1. 申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以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，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

（五）申购和赎回的数额限制

1、申购金额的限制

通过本公司网站或代销机构，场外申购本基金的，每个基金账户每次单笔申购金额不得低于0.01元(含申购费)，代销机构另有规定的，从其规定。通过直销柜台场外申购的，每个基金账户首次申购金额不得低于1万元(含申购费)，已在直销

机构有申购本基金记录的投资者不受上述申购最低金额的限制，单笔追加申购最低金额为0.01元（含申购费）。代销机构的投资者欲转托管入直销柜台进行交易的，要受直销柜台最低申购金额的限制。

通过场内申购时，每笔申购金额最低为1,000元人民币，同时每笔申购必须是100元的整数倍，并且单笔申购最高不超过99,999,900元。

2、赎回份额的限制

基金份额持有人通过场外赎回时，每次赎回申请不得低于0.01份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额。

基金份额持有人通过场内赎回时，每次赎回申请不得低于100份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额，并且单笔赎回最多不超过99,999,999份基金份额。

3、最低保留余额的限制

每个工作日基金份额持有人在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足0.01份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，则基金管理人有权将基金份额持有人在账户保留的本基金基金份额余额一次性同时全部赎回。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可根据市场情况，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》的有关规定在规定媒介公告并报中国证监会备案。

各代销机构可根据本基金管理人的调整方案进行调整，但单笔最低申购金额、单笔追加申购最低金额、单笔赎回最低份额不得低于管理人设定的上述值，可以等于或高于上述值。具体以各代销机构公布的公告为准，投资者需遵循各代销机构的相关规定。

（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 申购费

本基金的场外申购费率如下表：

①通过本公司直销柜台前端申购本基金的养老金客户申购费率如下表：

| 申购金额(含申购费) | 费率 |
|-----------------|-----------|
| 100万元以下 | 0.48% |
| 100万元(含)至500万元 | 0.28% |
| 500万元(含)至1000万元 | 0.08% |
| 1000万元(含)以上 | 每笔交易1000元 |

②非养老金客户前端申购本基金的申购费率如下表:

| 申购金额(含申购费) | 申购费率 |
|-----------------|------------|
| 100万元以下 | 1.20% |
| 100万元(含)至500万元 | 0.70% |
| 500万元(含)至1000万元 | 0.20% |
| 1000万元(含)以上 | 每笔交易1,000元 |

注:1)申购费用由基金申购人承担,不列入基金资产,可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金存续期间发生的各项费用。

2)投资者可以多次申购,申购费率按每笔申购申请单独计算。

3)因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

投资者通过国联安基金网上直销平台申购本基金可享受前端申购费率优惠。具体优惠申购费率以最新的相关公告为准。基金管理人不会设置申购金额上限,但各银行卡具体的申购上限要遵守各银行网上银行上限标准。本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求,并依据相关法规的要求提前进行公告。

基金份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

申购金额包括申购费用和净申购金额,计算公式为:

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

通过场外方式进行申购的,申购份额计算结果保留到小数点后2位,小数点后2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有;通过场内方式申购的,申购份额计算结果保留到整数位,计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例1:某投资者通过场外投资10,000.00元申购本基金,申购费率为1.20%,假定申购当日的基金份额净值为1.050元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额 = 10,000.00 / (1 + 1.20%) = 9,881.42元

$$\text{申购费用} = 10,000.00 - 9,881.42 = 118.58 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 9,881.42 / 1.050 = 9,410.88 \text{份}$$

例2：如例1，如果该投资者选择通过场内申购，假定申购费率也为1.20%，则因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为9,410.00份，不足1份部分对应的申购资金返还给投资者。计算方法如下：

$$\text{实际净申购金额} = 9,410.00 \times 1.050 = 9,880.50 \text{元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000.00 - 9,880.50 - 118.58 = 0.92 \text{元}$$

2. 赎回费

本基金的场外赎回费率如下表：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|-----------------|-------|
| 持有期 < 7 日 | 1.50% |
| 7 日 ≤ 持有期 < 1 年 | 0.50% |
| 1 年 ≤ 持有期 < 2 年 | 0.25% |
| 持有期 ≥ 2 年 | 0% |

注：1) 1年按365天计算。

2) 赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。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。

本基金的场内赎回费率如下表：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|-----------|-------|
| 持有期 < 7 日 | 1.5% |
| 持有期 ≥ 7 日 | 0.50% |

赎回金额的计算采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日基金份额净值为基准进行计算，计算公式为：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日的基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

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

例3：某投资者赎回10,000.00份基金份额，持有时间为8个月，对应的赎回费

率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.050元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000.00 \times 1.050 = 10,500.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,500.00 \times 0.50\% = 52.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,500.00 - 52.50 = 10,447.50 \text{元}$$

3. 基金份额净值计算：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，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。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。

4. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

5. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的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必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(七) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6. 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基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。

7. 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，

基金管理人暂停基金估值并采取暂停接受基金申购申请的措施。

8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形（第4、6项除外）时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第6项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运转。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停基金估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过20个工作日，并在规定媒介上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

（九）巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）

超过上一开放日基金总份额的10%，即认为发生了巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

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

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 本基金发生巨额赎回时，对于在开放日单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请，基金管理人可以进行延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

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

投资者在场内办理赎回业务发生巨额赎回时，遵循证券交易所及注册登记机构的相关业务规则处理。

3. 巨额赎回的公告

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

（十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2. 暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在规定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

(十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

1、基金转换费及转换份额的计算

(1) 转换费

进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。

1) 转换手续费率为零。如基金转换手续费率调整将另行公告。

2) 转换份额的计算公式：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

转换费用 = 转换手续费 + 转出基金的赎回费 + 申购补差费

其中：

转换手续费 = 0

赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

申购补差费 = (转出金额 - 赎回费) × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率)

1) 如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费 + 申购补差费

2) 如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率

转换费用 = 转出基金的赎回费

3) 转入金额 = 转出金额 - 转换费用

4) 转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值

其中, 转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额作为确定依据。

注: 转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

(3) 基金转换业务举例:

例: 某投资者通过场外投资101,200.00元申购本基金, 申购费率为1.20%, 申购申请当日基金份额净值是1.000元, 则可申购场外基金份额100,000.00份。持有一年半后, 该投资者将这100,000.00份场外基金份额转换为场外国联安中证100指数(LOF)份额, 转换申请当日国联安中证100指数(LOF)份额净值为1.000元, 本基金的基金份额净值为1.050元。则:

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值=100,000.00×1.050
=105,000.00元;

赎回费=转出金额×转出基金赎回费率=105,000.00×0.25%=262.50元;

申购补差费=0.00元;

转换费用=赎回费+申购补差费=262.50元;

转入金额=转出金额-转换费用=105,000.00-262.50=104,737.50元;

转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值=104,737.50/1.000=
104,737.50份。

2、转换业务规则

(1) 基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时, 转出的基金必须处于可赎回状态, 转入的基金必须处于可申购状态。

(2) 基金转换采取未知价法, 即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

(3) 正常情况下, 基金注册登记机构将在T+1日对投资者T日的基金转换业务申请进行有效性确认。在T+2日后(包括该日)投资者可在相关网点查询基金转换的成交情况。

(4) 目前, 每次对上述单只基金转换业务的申请原则上不得低于100份基金份额; 且如因某笔基金转出业务导致该基金单个交易账户的基金份额余额少于100份时, 基金管理人将该交易账户保留的基金份额余额一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

(5) 单个开放日单只基金净赎回申请(赎回申请份额与转出申请份额总数,

扣除申购申请份额与转入申请份额总数后的余额) 超过上一开放日该基金总份额的 10% 时, 即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时, 基金转出与基金赎回具有相同的优先等级, 基金管理人可根据该基金资产组合情况, 决定全额转出或部分转出, 并且对于基金转出和基金赎回采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下, 未确认的转出申请将不予以顺延。

(6) 目前, 原持有基金为前端收费模式下基金份额的, 只能转换为其他前端收费模式的基金份额, 后端收费模式下的基金份额只能转换为其他后端收费模式的基金份额。

(7) 目前, 原持有的基金为场外份额的, 只能转换为其他场外基金份额。原持有的基金为场内份额的, 由于目前场内尚未开通基金转换业务, 若持有场内基金份额的投资者欲办理转换业务, 投资者须先通过跨系统转登记的方式将场内基金份额转为场外基金份额, 然后再进行基金的转换。

(8) 通过基金管理人网上直销系统办理前端收费模式下本基金管理人旗下部分基金的转换业务, 享有费率优惠, 有关详情敬请参见相关公告或咨询本基金管理人客户服务中心。

上述业务规则具体以本基金注册登记机构的相关规定为准。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内根据实际情况调整转换业务规则并公告。

(十二) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划, 具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额, 每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

具体内容参见本招募说明书“二十七、对基金份额持有人的服务”之“(二) 定期定额投资计划”。

十、基金份额的上市交易

(一) 上市交易的地点

深圳证券交易所。

(二) 上市交易的时间

本基金于2015年5月20日开始在深圳证券交易所上市交易。

(三) 上市交易的规则

本基金基金份额上市首日的开盘参考价为前一工作日的基金份额净值；本基金基金份额上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

(四) 上市交易的费用

本基金基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

(五) 上市交易的行情揭示

本基金基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值。

(六) 上市交易的停复牌与暂停、终止上市

本基金基金份额的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

(七) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十一、基金份额的系统内转托管、跨系统转登记等其他相关业务

(一) 基金份额的登记

1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购买的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

3、登记在证券登记结算系统中的基金份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

(二) 系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

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

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或基金份额场内赎回业务的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理系统内转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理系统内转托管时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

(三) 跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、基金份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3、投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转登记业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人

可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转登记时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。

(四) 基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻

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

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

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、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

十二、基金的投资

(一) 投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,力争保持基金净值收益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0.35%,年跟踪误差不超过4%,为投资者提供一个投资中小企业综合指数的有效工具,从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。

(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,包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含原中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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

本基金管理人自《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上述相关规定。

(三) 投资策略

本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成份股,构建目标组合,实现稳定地跟踪目标指数的目的。

1、目标组合的构建

(1) 股票的筛选

中小企业综合指数成份股包括在深圳原中小板上市交易的所有股票,本基金在抽样复制时,将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

(2) 初步确定目标组合成份股和权重

采取市值优先抽样法，对筛选出来的股票，按股票的流通市值从大到小排序，初步确定目标组合的成份股和权重。

(3) 目标组合成份股及权重的调整

根据初步确定的目标组合成份股及权重，按照行业分类，得到目标组合的行业权重。将目标组合的行业权重与中小企业综合指数的行业权重进行比较，如果某个行业两者出现较大偏离，通过调整组合成份股及权重并优化，确定最终的目标组合的成份股及权重，使得目标组合的行业权重与中小企业综合指数对应行业的权重大致吻合。

为了能够更好的跟踪中小企业综合指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种规定媒介上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

2、目标组合的调整

(1) 组合调整原则

本基金为指数型基金，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、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2) 组合调整方法

1) 组合定期调整

每季度末根据上述抽样复制方法和组合调整原则调整股票组合及个股配置比例。

2) 组合不定期调整

对投资组合进行动态跟踪，当行业的权重与基准产生较大偏差时，对成份股进行相应调整，以保证跟踪误差的最小化。

根据中小企业综合指数的编制规则，因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整，分析上述事件对组合跟踪误差的影响，并制定合理的组合调整策略。

3、股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为

目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

(四) 标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中小企业综合指数。

中小企业综合指数由中小板综合指数更名而来,中小板综合指数于2005年12月1日正式发布,覆盖了深圳证券交易所原中小企业板上市的全部股票,以综合反映深圳证券交易所中小企业公司的整体状况。在中国经济结构转型,工业化不断推进背景下,中小企业是整个经济体中最为活跃和创新的部分,中小企业综合指数是其良好的刻度和反映,具有较好的市场认知程度和接受度。

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: $95\% \times \text{中小企业综合指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率}$ (税后)。

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内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,并履行相应程序。

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。

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后,综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份股替代策略,并对投资组合进行相应调整。

(五) 风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

(六) 投资决策流程

1、投资依据

- (1) 有关法律、法规、基金合同等的相关规定；
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3、投资程序

(1) 首先运用数量化模型以及各种风险监控指标，结合公司内外的研究报告，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，提出研究分析报告。

(2) 投资决策委员会依据相关研究分析报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 基金经理根据标的指数，结合研究分析报告，原则上依据指数成份股的权重构建资产组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的技术和方法，降低交易成本，控制投资风险。

(4) 交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。

(5) 根据市场变化，定期和不定期评估基金投资绩效。风险管理部对基金投资计划的执行进行日常监督和风险控制。

(6) 基金经理密切跟踪标的指数的变动，结合成份股情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、绩效评估报告等，对投资组合进行监控和调整，实现对跟踪误差的有效控制。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并予以公告。

(七) 投资限制

1. 组合限制

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

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- (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) 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- (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) 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%；
- (9) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
- (10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (12) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (13) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进

行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

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

(15)本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(17)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—100%；

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

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

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

(21)法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

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

除上述第(9)、(12)、(19)、(20)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基

金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(八) 基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

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

(九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十) 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重

大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，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截至2021年03月31日，本报告财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 5,913,906.35 | 90.10 |
| | 其中：股票 | 5,913,906.35 | 90.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 648,128.69 | 9.87 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,587.96 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 6,563,623.00 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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 | 158,487.20 | 2.45 |
| B | 采矿业 | 43,007.12 | 0.66 |
| C | 制造业 | 4,419,245.87 | 68.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,744.12 | 0.38 |
| E | 建筑业 | 65,199.60 | 1.01 |
| F | 批发和零售业 | 129,706.36 | 2.00 |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 105,411.33 | 1.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,781.70 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 452,803.73 | 6.99 |
| J | 金融业 | 255,664.84 | 3.95 |
| K | 房地产业 | 40,704.92 | 0.63 |
| L | 租赁和商务服务业 | 121,731.87 | 1.88 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,920.00 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 24,462.09 | 0.38 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 26,716.80 | 0.41 |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,504.00 | 0.29 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 19,814.80 | 0.31 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,913,906.35 | 91.28 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 4,967 | 277,655.30 | 4.29 |
| 2 | 002304 | 洋河股份 | 862 | 141,971.40 | 2.19 |
| 3 | 002594 | 比亚迪 | 854 | 140,491.54 | 2.17 |
| 4 | 002142 | 宁波银行 | 2,945 | 114,501.60 | 1.77 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 3,098 | 104,805.34 | 1.62 |
| 6 | 002714 | 牧原股份 | 982 | 98,229.46 | 1.52 |
| 7 | 002049 | 紫光国微 | 900 | 96,291.00 | 1.49 |
| 8 | 002493 | 荣盛石化 | 3,409 | 93,883.86 | 1.45 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 8,900 | 82,592.00 | 1.27 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 10 | 002371 | 北方华创 | 500 | 71,770.00 | 1.11 |
|----|--------|------|-----|-----------|------|

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

11、投资组合报告附注

11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披

露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除宁波银行外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

宁波银行（002142）的发行主体宁波银行股份有限公司，因作为债务融资工具主承销商，在相关债务融资工具承销及发行工作开展中存在以不正当手段承揽业务、发行工作程序执行不到位、未按照规定开展询价工作等违反银行间市场相关自律管理规则的行为，于2020年12月31日被交易商协会采取警告、暂停债务融资工具相关业务、责令整改的行政监管措施。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 421.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 67.39 |
| 5 | 应收申购款 | 1,098.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,587.96 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

① 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

② 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在积极投资前五名股票流通受限情况。

十三、基金的业绩

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

| 日期 | 基金份额净值增长率① | 同期业绩比较基准收益率③ | ①-③ | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率标准差④ | ②-④ |
|---------------------------|------------|--------------|---------|-----------|---------------|--------|
| 2015-03-24至
2015-12-31 | 18.17% | 24.51% | -6.34% | 2.92% | 2.75% | 0.17% |
| 2016-01-01至
2016-12-31 | -12.63% | -14.00% | 1.37% | 1.72% | 1.80% | -0.08% |
| 2017-01-01至
2017-12-31 | 0.09% | -1.12% | 1.21% | 0.78% | 0.83% | -0.05% |
| 2018-01-01至
2018-12-31 | -33.87% | -33.79% | -0.08% | 1.36% | 1.37% | -0.01% |
| 2019-01-01至
2019-12-31 | 28.12% | 30.26% | -2.14% | 1.34% | 1.38% | -0.04% |
| 2020-01-01至
2020-12-31 | 23.40% | 29.98% | -6.58% | 1.54% | 1.53% | 0.01% |
| 2021-01-01至
2021-03-31 | -5.44% | -4.02% | -1.42% | 1.36% | 1.39% | -0.03% |
| 2015-03-24至
2021-03-31 | 2.17% | 13.91% | -11.74% | 1.67% | 1.65% | 0.02% |

十四、基金的财产

(一) 基金资产总值

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

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，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。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十五、基金资产的估值

(一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的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

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市的债券，采用估值技术确定公允价值。对在交易所市场上市交易的不含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；对在交易所市场上市交易的含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值；

(3) 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；

(4) 对在交易所市场交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票和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、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。

- 4、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
- 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、中小企业私募债券采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定中小企业私募债券的公允价值。中小企业私募债券采用估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。法律法规对中小企业私募债券估值有最新规定的，从其规定。
- 7、股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。
- 8、国债期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。
- 9、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。
- 10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（四）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1. 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、或代销机构、或投资人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当事人（“受损方”）的直接损失按下述“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不能预见、不能避免、不能克服，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人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财

产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(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。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

(3)因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理

(六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产

价值时；

3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金净值的确认

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

（八）特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十六、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) 收益分配原则

1. 场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；场内份额收益分配只采用现金红利一种方式，基金份额持有人不能自行选择；

2. 每一基金份额享有同等分配权；

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. 基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%；

5. 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；

6. 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、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) 收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案；

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十七、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金的开户费用、账户维护费用；
9. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10. 基金上市费及年费；
11. 标的指数使用许可费；
12. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 基金合同生效后的指数使用许可费

指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付，收取标准和方法为：

$$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H = 每日应付的指数使用许可费；E = 前一日基金的资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

4. 除管理费、托管费和指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在规定媒介上刊登公告。

（四）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十八、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. 本基金的会计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书面确认。

(二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

十九、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会规定的全国性报刊(以下简称“规定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

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份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。公开披露的基金信息包括：

(一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在规定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在规定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

(二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在规定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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规定报刊和网站上。

（四）基金合同生效公告

基金管理人将在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

（五）上市交易公告书

本基金获准在证券交易所上市交易，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将上市交易公告书登载在规定报刊和网站上。

（六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2. 本基金在上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在规定报刊和网站上。

（七）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（八）基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

1. 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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。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；

2. 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

中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上；

3. 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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上；

4. 《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；

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

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

（九）临时报告与公告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

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

14. 重大关联交易事项；

15. 基金收益分配事项；

16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；

18. 基金改聘会计师事务所；

19. 基金变更、增加或减少代销机构；

20. 基金更换注册登记机构；

21. 本基金开始办理申购、赎回；

22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；

24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26. 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；

27. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

(十) 澄清公告

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

(十一) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

(十二) 中国证监会规定的其他信息

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

(十三) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、中期报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人

所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。本基金的上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人和上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。

投资人也可在基金管理人规定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在规定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

二十、风险揭示

(一) 投资于本基金的风险

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

1、市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，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。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(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。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，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。

2、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，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

3、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。由于开放式基金在国内发展历史不长，应对基金赎回的经验不足，

加之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。

4、其他风险

(1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

(2) 因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

(3) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 因业务竞争压力可能产生的风险；

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

(7) 其他意外导致的风险。

5、本基金的特定风险

(1) 指数投资风险。本基金为股票型指数基金，投资标的为中小企业综合指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2) 标的指数跟踪误差风险

因标的指数成份股调整、增发、配股、分红等，或者因新股认购、基金现金资产拖累、基金交易成本和交易冲击以及基金费用的提取等原因，基金的收益水平相对于标的指数回报率可能出现偏离，从而导致出现跟踪误差风险。

3) 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

(2) 跟踪中小企业综合指数特有的风险

中小企业综合指数是一个开放型价格指数，新股发行调入指数后，导致成分股权重发生一定变化，相对于一般定期调整的指数，对新股发行更加敏感，增加了跟

踪指数的难度。

本基金采用抽样复制的方法，抽样复制方法是在历史数据基础上根据一定模型进行抽样样本的选择，抽样复制本身具有一定的模型风险，尽管管理人将采取严格的风险管理措施，但仍存在不能很好跟踪指数的风险。

（3）基金运作的特有风险

1) 基金份额的风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，但标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（5）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并履行相应程序。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（6）成份股停牌的风险

成份股可能因各种原因临时或长期停牌。发生停牌时，基金可能面临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的风险。

（二）声明

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

二十一、基金合同的变更、终止与基金财产清算

(一) 基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4) 变更基金份额持有人大会程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 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；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种规定媒介公告。

(二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

3. 清算费用

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

4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

二十二、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利义务

(一)基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8. 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；
9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13. 依法召集基金份额持有人大会；
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(二)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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. 计算并公告基金净值信息、国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)份额的基金份额净值、国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)份额的申购、赎回价格;
9. 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;
10. 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
12. 编制中期和年度基金报告;
13. 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;
14. 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、投资意向等, 除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;
15. 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;
16. 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;
17. 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;
18. 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;
19. 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;

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, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23. 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;

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议;

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26. 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, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的权利为:

1. 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;

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作;

3. 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;

4. 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

6. 依法召集基金份额持有人大会;

7. 按规定取得基金份额持有人名册资料;

8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(四) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

1. 安全保管基金财产;

2. 设立专门的基金托管部, 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. 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；
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应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 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；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)份额的基金份额净值；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 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；
16. 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；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 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；
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21. 执行生效的基金份额持有人大会决议;
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
23. 建立并保存基金份额持有人名册;
24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(五) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益;
2. 参与分配清算后的剩余基金财产;
3. 依法转让、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、基金份额发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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(六) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
3. 在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份额持有人合法权益的活动;
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议;
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金

份额拥有平等的投票权。

(一) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%，下同)的基金份额持有人。以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 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；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 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，应当自行召集。

3. 代表基金份额10%以上的基金份额持有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。

4. 代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5. 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。

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对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，不影响计票和表决结果。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定。

2. 召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

(2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本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或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上;

5) 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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

(五) 议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额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就召开事由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。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额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,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。法律法规另有规定的除外。

(5) 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，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 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。

(六) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4. 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

(七) 计票

1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则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推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,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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(八)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。

2. 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。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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在规定媒介公告。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。

(九)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金合同的变更与终止的事由和程序

(一)基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
 - (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)的申购费率、赎回费率或收费方式；
 - (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
 - (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
 - (5) 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；
 - (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种规定媒介公告。

(二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

基金财产清算程序主要包括:

- (1) 基金合同终止后, 发布基金财产清算公告;
- (2) 基金合同终止时, 由基金财产清算组统一接管基金财产;
- (3) 对基金财产进行清理和确认;
- (4) 对基金财产进行估价和变现;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9) 公布基金财产清算结果;
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

3. 清算费用

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

4. 基金财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付清算费用;
- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告; 清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算结果经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,

任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

二十三、基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：国联安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

邮政编码：200121

法定代表人：于业明

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币1.5亿元

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

(二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

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

业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含原中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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

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

(1) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(2) 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%;

(3) 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;

(4) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

(6) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持

有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

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

(10)本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的5%；

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

(12)本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

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

(14)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—100%。

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

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

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

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

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

除上述第(6)、(9)、(16)、(17)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，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、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如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。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

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

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

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

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

1. 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

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

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

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

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

票相关流动性风险处置预案。

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

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

- (1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- (2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- (3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- (4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

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

6. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

- (六) 基金托管人根据相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。

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

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

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

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

三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一) 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。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账

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

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

四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。
7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二) 基金募集期间及募集资金的验资

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

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

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

（三）基金银行账户的开立和管理

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

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差

资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

(五) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

(六) 其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

(七) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

(八) 与基金财产有关的重大合同的保管

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

五、基金资产净值计算和复核

(一) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金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分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

七、争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

八、托管协议的变更与终止

(一) 托管协议的变更程序

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

(二) 基金托管协议终止出现的情形

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

二十四、对基金份额持有人的服务

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

（一）基金份额持有人登记服务

基金管理人担任基金份额登记机构为基金份额持有人提供登记服务，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、转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发，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）信息定制服务

投资者可以通过基金管理人网站（www.cpicfunds.com）、官方微信账号（神基太保）、客服电话（400-700-0365；021-38784766）等渠道提交信息定制服务申请。信息定制服务包括短信定制信息和邮件定制信息，投资者申请时应提供有效联系方式。在申请获基金管理人确认后，基金管理人可通过投资者提供的有效手机号码、电子邮件等联系方式，为投资者发送所定制的信息。短信定制信息包括：电子对账单、持有基金周末净值等信息；邮件定制信息包括：电子对账单等信息。

客服中心于每月1日向投资者发送月度电子对账单，于每年度结束后20个工作日内，向投资者发送年度电子对账单。基金管理人将根据业务发展需要和实际情况，适时调整信息定制服务内容。

（三）客服中心

1、客服中心电话服务

（1）自动语音服务

呼叫中心自动语音查询系统提供7*24小时自动语音服务和查询服务，客户可通过电话查询基金份额净值、基金账户余额等信息。

（2）人工服务

客服中心提供每周5个工作日的人工服务。

客服中心电话：021-38784766、400-700-0365（免长途话费）

2、网上客户服务

网上客户服务为投资者提供查询服务、资讯服务以及相互交流的平台。投资者可以查询热点问题，并对服务进行投诉和建议。

网址：www.cpicfunds.com

客服电子邮箱: customer.service@cpicfunds.com

(四) 网上交易服务

基金管理人大力发展基金电子商务, 并已开通基金网上交易系统, 投资者可登陆基金管理人的网站(www.cpicfunds.com)、手机APP(名称: 国联安基金), 更加方便、快捷地办理基金交易及信息查询等已开通的各项基金网上交易业务。同时, 投资者可关注基金管理人官方微信账号(名称: 神基太保), 快速实现净值查询功能, 绑定个人账户之后, 还可实现账户查询功能。基金管理人也将不断努力完善现有技术系统和销售渠道, 为投资者提供更加多样化的交易方式和手段。

基金网上交易业务的解释权归基金管理人所有。

(五) 客户投诉受理服务

投资者可以通过电话(021-38784766, 400-700-0365)、邮件(customer.service@cpicfunds.com)、网上留言、书信等主要投诉受理渠道对基金管理人的工作提出投诉和建议, 客户服务人员会及时地进行处理。

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

二十五、其他应披露事项

| 公告名称 | 披露媒体 | 披露日期 |
|---|---------------------------|------------|
| 国联安基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 规定报刊、规定网站 | 2021-01-05 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 2020 年第四季度报告 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-01-22 |
| 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021-01-22 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 招募说明书更新 (2021 年第 1 号) | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-02-08 |
| 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定报刊、规定网站 | 2021-02-18 |
| 国联安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 规定报刊、规定网站 | 2021-03-05 |
| 国联安基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 规定报刊、规定网站 | 2021-03-05 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-31 |
| 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2021-03-31 |
| 国联安基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告 | 规定报刊、规定网站、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2021-03-31 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金合同 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-03-31 |
| 国联安基金管理有限公司关于国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 更名的公告 | 规定报刊、规定网站、深圳证券交易所 | 2021-04-02 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-04-06 |
| 国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新) | 规定网站、深圳证券交易所 | 2021-04-06 |

二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资人也可在基金管理人规定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十七、备查文件

- (一) 中国证监会核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的文件
- (二) 《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- (三) 《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

国联安基金管理有限公司

二〇二一年五月二十日