

# 博时中证新能源交易型开放式指数 证券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

## 【重要提示】

1、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金根据 2021 年 2 月 3 日中国证券监督管理委员会《关于准予博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]397 号）准予注册，进行募集。

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

3、本基金的标的指数为中证新能源指数，编制方案如下：

(1) 样本空间

同中证全指指数的样本空间

(2) 选择方法

1) 对样本空间内的股票按照最近一年（新股上市以来）的 A 股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的股票；

2) 对样本空间的剩余股票，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票进入新能源主题；

3) 将 (2) 中剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 80 的股票作为指数样本股。

(3) 指数计算

指数计算公式为：报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000

其中，调整市值=∑(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：

<http://www.csindex.com.cn/>。

4、证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型

基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证新能源指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金按照基金份额初始面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

5、因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以 1 元初始面值开展基金募集或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值或 1 元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

6、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，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，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等，详见下文“风险揭示”章节。

7、基金合同生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。因此本基金有面临自动清算的风险。

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

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要等文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得会高于或低于投资人先前所

支付的金额。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，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。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金销售机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

本招募说明书（更新）所载内容截止日 2021 年 11 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 09 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目录

|                                |     |
|--------------------------------|-----|
| 【重要提示】 .....                   | 2   |
| 第一部分 绪言 .....                  | 6   |
| 第二部分 释义 .....                  | 7   |
| 第三部分 基金管理人 .....               | 13  |
| 第四部分 基金托管人 .....               | 29  |
| 第五部分 相关服务机构 .....              | 32  |
| 第六部分 基金的募集与基金合同的生效 .....       | 40  |
| 第七部分 基金的份额折算与变更登记 .....        | 41  |
| 第八部分 基金份额的上市交易 .....           | 42  |
| 第九部分 基金份额的申购与赎回 .....          | 44  |
| 第十部分 基金的投资 .....               | 57  |
| 第十一部分 基金的业绩 .....              | 70  |
| 第十二部分 基金的财产 .....              | 71  |
| 第十三部分 基金资产的估值 .....            | 72  |
| 第十四部分 基金的收益与分配 .....           | 78  |
| 第十五部分 基金的费用与税收 .....           | 80  |
| 第十六部分 基金的会计与审计 .....           | 82  |
| 第十七部分 基金的信息披露 .....            | 83  |
| 第十八部分 风险揭示 .....               | 90  |
| 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 97  |
| 第二十部分 基金合同的内容摘要 .....          | 99  |
| 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要 .....       | 115 |
| 第二十二部分 对基金份额持有人的服务 .....       | 127 |
| 第二十三部分 其他应披露的事项 .....          | 128 |
| 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....     | 130 |
| 第二十五部分 备查文件 .....              | 131 |

## 第一部分 绪言

《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《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》”）以及《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

1. 基金或本基金：指博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金
2. 基金管理人：指博时基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中信建投证券股份有限公司
4. 基金合同：指《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书或本招募说明书：指《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新
7. 基金份额发售公告：指《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
8. 基金产品资料概要：指《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
9. 上市交易公告书：指《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》
10. 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
11. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13. 《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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修改的《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

14. 《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

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

16. 业务规则：指上海证券交易所、登记机构、基金管理人及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订

17. 《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年颁布、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

18. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19. 基金合同当事人：指受基金合同约定，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

20. 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

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

22. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

23. 人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

24. 投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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

25. 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

26. 发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构



27. 申购、赎回代理券商：指基金管理人指定的，在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司
28. 直销机构：指博时基金管理有限公司
29. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购、赎回代理券商（代办证券公司）
30. 销售机构：指直销机构与代销机构
31. 登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
32. 登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者账户的建立和管理、基金份额登记、基金交易的确认、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
33. 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
34. 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
35. 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
36. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
37. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
38. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
39. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
40. 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
41. 开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
42. 认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
43. 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，以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人申请购买基金份额的行为

44. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书的规定，将基金份额兑换为申购赎回清单规定的赎回对价的行为
45. 申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
46. 申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
47. 赎回对价：指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
48. 组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
49. 标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证新能源指数及其未来可能发生的变更
50. 完全复制法：指一种跟踪指数的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合，达到复制指数的目的
51. 现金替代：指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
52. 现金替代退补款：指投资人支付的现金替代与基金购入被替代成份证券的成本及相关费用的差额。若现金替代大于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则本基金需向投资人退还差额，若现金替代小于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则投资人需向本基金补缴差额
53. 现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算
54. 最小申购、赎回单位：指本基金申购、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍
55. 基金份额参考净值：指基金管理人或基金管理人委托其他机构在交易时间内根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

56. 预估现金部分：指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额
57. 元：指人民币元
58. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
59. 基金份额折算：指基金管理人根据基金合同规定将投资人的基金份额进行变更登记的行为
60. 收益评价日：指基金管理人计算本基金份额净值增长率与标的指数同期增长率差额之日
61. 基金份额净值增长率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）
62. 标的指数同期增长率：指收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%（期间发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）
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. 规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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
68. 交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”
69. 联接基金：指将绝大部分基金财产投资于博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金（目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，获得与指数收益相似的回报，采用开放式运作方式的基金

70. 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

71. 转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

72. 特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》所定义机构投资者

73. 中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

74. 不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址： 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人： 江向阳

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话： (0755) 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设四十五个直属部门，分别是：权益投资一部、权益投资二部、权益投资三部、权益投资四部、境外投资部、行业研究部、固定收益投资一部、固定收益投资二部、固定收益投资三部、固定收益研究部、混合资产投资部、宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、基础设施投资管理部、综合解决方案投资部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-北京、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部、央企业务部、互联网金融部、财富管理部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、登记清算部、风险管理部和监察法律部。

权益投资一部、权益投资二部、权益投资三部、权益投资四部、境外投资部分别负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。行业研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行

业上市公司及市场的研究。固定收益投资一部、固定收益投资二部、固定收益投资三部、固定收益研究部、混合资产投资部分别负责公司所管理的各类固定收益资产、混合资产的投资和研究工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策的拟订；牵头组织落实公司总体市场战略，协同产品和投资体系以及机构业务团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；机构产品营销组织和销售支持；专户业务中台服务与运营支持等工作。战略客户部集中服务国有银行、政策性银行、大型头部保险公司、中央汇金公司等重要金融机构。机构-北京负责北方地区其他银行、保险和财务公司等机构业务。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务、大宗交易业务、融券业务、做市商业业务、股指期货业务等工作。零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责总行渠道维护，零售产品营销组织、销售督导；营销策划及公募销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。基础设施投资管理部负责公司所管理基础设施资产的投资管理、项目运营、内部控制、风险管理及相关工作。综合解决方案投资部负责通过 FOF/MOM 主动管理资产配置，为客户量身定制跨一二级市场解决方案，同时负责主动管理资产的投资管理、产品运营、内部控制、风险管理等工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计、重要政府部门、监管部门以及交易所、外汇交易中心等证券市场重要主体的关系维护等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。

财富管理部负责高端客户的理财服务与销售。客户服务中心负责电话咨询与服务；网络咨询与服务；电话呼出业务；营销数据分析统计、直销柜台业务等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计等业务。登记清算部负责资金清算与交收、注册登记等工作。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2021 年 9 月 30 日，公司总人数为 719 人，其中研究员和基金经理超过 90%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## 二、主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

江向阳先生，博士。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。1997 年 8 月至 2014 年 12 月就职于中国证监会，历任办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副

总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。2015年7月至2020年10月任博时基金管理有限公司总经理。自2020年1月9日至2020年4月15日代为履行博时基金董事长职务。自2020年4月1日起任博时基金管理有限公司党委书记。自2020年4月15日起，任博时基金管理有限公司董事长。

苏敏女士，分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014年9月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事；自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长；自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011年3月至2015年8月担任中国海运（集团）总公司总会计师；自2007年5月至2011年4月担任安徽省能源集团有限公司总会计师，并于2010年11月至2011年4月担任该公司副总经理。自2018年9月3日起，任博时基金管理有限公司董事。

高阳先生，中共党员，经济学硕士，CFA，总经理。1998年7月至2000年2月在中国国际金融股份有限公司任销售交易部经理。2000年3月至2008年2月在博时基金管理有限公司历任债券组合经理、固定收益部总经理、基金经理、股票投资部总经理。2008年8月至2021年1月在鹏华基金管理有限公司工作，2008年12月至2021年1月在在鹏华基金管



理有限公司任副总经理。自 2021 年 2 月 5 日起，任博时基金管理有限公司总经理。自 2021 年 4 月 7 日起，任博时基金管理有限公司第八届董事会董事。

姚俊先生，博士。1993 年至 1997 年在华南理工大学学习，获双学士学位。1997 年至 2000 年在华南理工大学工商管理专业学习，获硕士学位。2002 年 9 月至 2005 年 7 月在华南理工大学管理专业学习，获得博士学位。2000 年 6 月至 2002 年 8 月任广东电信广州分公司业务部业务主管。2005 年 9 月至 2007 年 7 月，招商局集团博士后工作站任博士后研究员。2007 年 8 月至 2014 年 5 月，任招商证券研究发展中心分析师。2014 年 6 月至 2015 年 6 月任招商证券研究发展中心二部总经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 7 月任招商证券研究发展中心二部副总经理（主持工作）。2016 年 7 月至 2020 年 3 月任招商证券研究发展中心二部总经理。2020 年 3 月至今任招商证券财富管理及机构业务总部财富管理部总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

何翔先生，北京大学财务学专业学士。1995 年 7 月至 2000 年 2 月任中国农业银行广西分行国际业务部科员、副科长。2000 年 2 月至 2012 年 2 月任中国长城资产管理公司南宁办事处副科长、科长、副处长、高级经理。2012 年 2 月至 2014 年 12 月，任中国长城资产管理公司乌鲁木齐办事处总经理助理、副总经理；2014 年 12 月至 2018 年 2 月，任中国长城资产管理公司广西分公司副总经理。2018 年 2 月至 2019 年 8 月中国长城资产管理股份有限公司资金管理部副总经理。2019 年 8 月至今，任中国长城资产管理股份有限公司投资投行部（资产经营三部）副总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

李楚楚女士，香港注册会计师。2008 年以全额奖学金被香港中文大学录取，并获得工商管理学士学位。2012 年起加入毕马威香港办公室审计部门，为大型企业提供上市财务、审计、商业咨询及资本市场服务；2014 年起，调入毕马威香港办公室咨询部门，历任高级顾问和咨询经理，参与了众多并购、上市、尽职调查、公司治理、合规管理、风险管理等项目，积累了丰富的行业知识及企业运营管理经验。2017 年，加入上海信利股份投资基金管理有限公司并工作至今，历任投资经理、投资总监、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司投资总监和上海盛业股权投资基金有限公司监事，负责股权投资项目管理。李女士在私募股权投资、投后管理等方面拥有丰富的经验，领导并管理了多个行业的投资，包括金融服务（保险、资产管理、金融科技等）、医疗保健、消费与零售、新能源与环境、科技与媒体通信等。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

姜立军先生，1955年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974年12月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铃海运服务公司财务部经理、中远（英国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7，任中远航运股份有限公司（A股上市公司）首席执行官、董事。2008.8-2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行（A+H上市公司）执行董事、总经理。2012.2-2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9-2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。自2017年11月3日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

赵如冰先生，1956年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。赵如冰先生历任葛洲坝水力发电厂工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记；1989.09—1991.10任葛洲坝至上海正负50万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条直流输电工程的安装调试和运行。1991.10—1995.12任厂办公室主任兼外事办公室主任。1995.12—1999.12，赵如冰先生任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码0037）副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长。2000.01-2004.07，华能南方公司被国家电力公司重组后，任华能房地产开发公司副总经理，长城证券有限责任公司副董事长。2004.07-2009.03，赵如冰先生任华能房地产开发公司党组书记、总经理。2009.12-2016.8，赵如冰先生任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长兼长城证券公司党委副书记。2016.8-2020.03，赵如冰先生任阳光资产管理股份有限公司副董事长；2016.8-至今，任西南证券、百隆东方独立董事，2020.03-至今深圳市深粮控股股份有限公司独立董事。自2017年11月3日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

宋子洲先生，1960年生，中国保险资产管理业协会金融科技委员会主任委员。历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理，中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监、首席风险官、副总裁。从事保险资金投

资管理工作 20 余年，在保险资产管理公司的投资、运营、风险管理等方面积累了丰富的经验。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

何敏女士，1975 年出生，中南财经大学会计学硕士。1999 年 7 月至 2006 年 4 月任招商证券股份有限公司财务部会计核算岗，2006 年 4 月至 2009 年 4 月任招商证券股份有限公司财务部总经理助理，2009 年 4 月至 2019 年 2 月任招商证券股份有限公司财务部副总经理，2019 年 2 月至今任招商证券股份有限公司财务部总经理。自 2019 年 4 月 10 日起，任博时基金管理有限公司监事会主席。

蒋伟先生，硕士。2011 年 3 月至 2017 年 5 月就职于中国长城资产管理公司，分别任办公室外事处一级业务员、业务副主管、业务主管。2017 年 5 月至 2020 年 7 月就职于长城罗斯基金管理有限公司任行政总监/执行董事。2020 年 7 月至今任中国长城资产管理有限公司资产经营三部副高级经理（处室负责人）。

赵兴利先生，硕士。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港（集团）公司委派货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月至 2020 年 6 月就职于天津港（集团）有限公司金融事业部副部长，天津港（集团）有限公司计财部副部长。2020 年 6 月至今任天津港（集团）有限公司专职董监事。自 2013 年 3 月起，任博时基金管理有限公司监事。

严斌先生，硕士。1997 年 7 月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。自 2015 年 5 月起，任博时基金管理有限公司监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995 年起先后在广州证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005 年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、公司总经理助理。现任公司首席资产配置官兼社保组合投资经理。自 2016 年 3 月 18 日起，担任博时基金管理有限公司监事。

车宏原先生，工学硕士。1985 年至 1989 年在四川大学计算机系学习，获得学士学位。1989 年至 1992 年在清华大学计算机系学习，获得硕士学位。1992 年至 1995 年深圳市天元

金融电子有限公司任技术部负责人，1995年至2000年在中国农业银行总行南方软件开发中心担任副总工程师，2001年至2003年在太极华清信息系统有限公司担任副总经理，2003年至2014年在景顺长城基金管理有限公司担任信息技术总监，2014年至2015年任中财国信（深圳）有限公司总经理，2015年至今担任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。

### 3、高级管理人员

江向阳先生，简历同上。

高阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理。现任公司副总经理、首席信息官，主管IT、指数与量化投资、养老金、基金零售等工作，兼任博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理的工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理兼首席固定收益投资官、混合资产投资部总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金（国际）有限公司董事会主席。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

### 4、本基金基金经理

尹浩先生，硕士。2012年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时创业板交易型开放式指数证券投资基金（2019年10月11日一至今）、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金（2019年10月11日一至今）、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接

基金(2019年10月11日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019年10月11日一至今)、博时中证5G产业50交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月27日一至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(2020年12月10日一至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020年12月30日一至今)、博时中证5G产业50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021年7月14日一至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(2021年7月15日一至今)、博时中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金(2021年8月19日一至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金(2021年9月24日一至今)的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：高阳、邵凯、黄健斌、邵佳民、魏凤春、过钧、曾鹏、蔡滨、黄瑞庆、金晟哲

高阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

邵佳民先生，硕士。1997年起先后在海通证券、海富通基金、中国人寿养老保险股份有限公司、平安资产管理公司工作。2021年加入博时基金管理有限公司，现任公司首席年金投资官。

魏凤春先生，博士。1993年起先后在山东经济学院、江南信托、清华大学、江南证券、中信建投证券工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2015年8月24日-2016年12月19日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015年11月30日-2016年12月19日)的基金经理、多元资产管理部总经理、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2019年3月20日—2020年9月3日)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(2019年8月28日—2020年9月3日)的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理。

过钧先生，硕士。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowe's食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005年8月24日-2010年8月4日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010年11月

24日-2013年9月25日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013年2月1日-2014年4月2日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014年1月8日-2014年6月10日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013年9月13日-2015年7月16日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015年6月24日-2016年7月4日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016年3月29日-2018年2月6日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月1日-2018年2月6日)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2014年6月10日-2018年4月23日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016年10月24日-2018年5月5日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2018年5月21日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月13日-2018年6月16日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017年1月10日-2018年7月30日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016年3月29日-2019年4月30日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016年9月29日-2019年10月14日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年1月28日-2020年4月3日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016年9月6日-2020年7月20日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月17日-2020年7月20日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2020年7月20日)、博时中债3-5年国开行债券指数证券投资基金(2019年7月19日-2020年10月26日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债3-5年进出口行债券指数证券投资基金(2018年12月25日-2021年8月17日)的基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009年6月10日-至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月29日-至今)、博时双季鑫6个月持有期混合型证券投资基金(2021年1月20日-至今)的基金经理。

曾鹏先生，硕士。2005年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015年2月9日-2016年4月25日)基金经理、权益投资主题组负责人、权益投资总部一体化投研总监。现任公司董事总经理兼权益投研一体化总监、权益投资四部总经理、权益投资四部投资总监、境外投资部总经理、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013年1月18日-至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018年6月21日-至今)、博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019年6月27日-至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020年4月15日-至今)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2021年1月20日-至今)的基金经理。

至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021年2月9日一至今)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2021年7月20日一至今)、博时消费创新混合型证券投资基金(2021年11月8日一至今)的基金经理。

蔡滨先生, 硕士。2001年起先后在上海振华职校、美国总统轮船(中国)有限公司、美国管理协会、平安证券工作。2009年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究部资本品组组长、研究部副总经理兼资本品组组长、博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)(2014年12月26日-2016年4月25日)、博时工业4.0主题股票型证券投资基金(2016年6月8日-2019年6月4日)的基金经理、权益投资成长组投资副总监、股票投资部副总经理(主持工作)、博时战略新兴产业混合型证券投资基金(2017年8月9日-2021年10月18日)的基金经理。现任权益投资三部投资总监兼博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金(2015年1月26日一至今)、博时外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月3日一至今)、博时逆向投资混合型证券投资基金(2017年11月13日一至今)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2018年8月23日一至今)、博时产业新趋势灵活配置混合型证券投资基金(2020年2月17日一至今)、博时产业精选灵活配置混合型证券投资基金(2020年11月6日一至今)、博时产业慧选混合型证券投资基金(2021年3月23日一至今)、博时产业优选灵活配置混合型证券投资基金(2021年7月20日一至今)、博时研究精选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2021年7月27日一至今)的基金经理。

黄瑞庆先生, 博士。2002年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013年加入博时基金管理有限公司, 历任股票投资部ETF及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监(主持工作)、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长混合基金(2015.2.9-2016.10.24)、博时价值增长贰号混合基金(2015.2.9-2016.10.24)、博时特许价值混合基金(2015.2.9-2018.6.21)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合基金(2017.5.4-至今)、博时量化多策略股票基金(2018.4.3-至今)、博时量化价值股票基金(2018.6.26-至今)的基金经理。

金晟哲先生, 硕士。2012年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、资深研究员、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金(2017

年2月28日-2017年12月1日)、博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月28日-2018年2月22日)、博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018年2月23日-2018年8月13日)、博时睿丰灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2017年3月22日-2018年12月8日)的基金经理、研究部副总经理、博时价值增长证券投资基金(2017年11月13日-2021年7月12日)、博时睿利事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017年12月4日-2021年7月12日)的基金经理、研究部副总经理(主持工作)。现任行业研究部副总经理(主持工作)兼博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月24日一至今)、博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)(2020年5月13日一至今)、博时荣泰灵活配置混合型证券投资基金(2020年8月26日一至今)、博时恒泰债券型证券投资基金(2021年4月22日一至今)、博时荣华灵活配置混合型证券投资基金(2021年9月7日一至今)。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、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价格、申购对价、赎回对价的方法符合《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、赎回对价，编制申购赎回清单；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；



- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定；
- 17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《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) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或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、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，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、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

(1) 全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

(2) 独立性原则

公司设立独立的监察部，监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

(3) 相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

(2) 风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

(3) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

(4) 监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

(5) 风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### (6) 业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、风险管理和内部风险控制的措施

#### (1) 建立内控结构，完善内控制度

公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

#### (2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

#### (3) 建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

#### (4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

#### (5) 建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

#### (6) 使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

#### (7) 提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

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

法定代表人：王常青

成立时间：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：中国证监会证监机构字[2005]112 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 77.57 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可【2015】219 号

中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京，注册资本 76.46 亿元，并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投（国际）金融控股有限公司、中信建投基金管理有限公司、中信建投投资有限公司等 5 家子公司。自成立以来，中信建投证券各项业务快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力，中信建投证券主要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验，业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

### 三、证券投资基金托管情况

中信建投证券于 2015 年 2 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”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，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部控制组织结构

中信建投证券设有风险管理委员会，负责全公司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。托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部行政负责人的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

##### 3、内部控制制度及措施

中信建投证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保障托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

##### 2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托管协议的规定，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限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对

通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

##### (1) 国泰君安证券股份有限公司

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址：   | 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号                                  |
| 办公地址：   | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 21 层                                |
| 法定代表人：  | 贺青  |
| 联系人：    | 钟伟镇   |
| 电话：     | 021-38676666  |
| 传真：     | 021-38670666  |
| 客户服务电话： | 95521/4008888666  |
| 网址：     | <a href="https://www.gtja.com">https://www.gtja.com</a> |

##### (2) 中信建投证券股份有限公司

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址：   | 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼   |
| 办公地址：   | 北京市朝阳区门内大街 188 号  |
| 法定代表人：  | 王常青   |
| 联系人：    | 李凯  |
| 电话：     | 010-65608231  |
| 传真：     | 010-65182261  |
| 客户服务电话： | 4008888108/95587  |
| 网址：     | <a href="http://www.csc108.com/">http://www.csc108.com/</a> |

##### (3) 国信证券股份有限公司

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址：   | 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层                                   |
| 办公地址：   | 深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 21 楼                                      |
| 法定代表人：  | 张纳沙   |
| 联系人：    | 李颖  |
| 电话：     | 0755-82130833   |
| 传真：     | 0755-82133952   |
| 客户服务电话： | 95536   |
| 网址：     | <a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a> |

##### (4) 招商证券股份有限公司

|        |                             |
|--------|-----------------------------|
| 注册地址：  | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号        |
| 办公地址：  | 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼 |
| 法定代表人： | 霍达                          |
| 联系人：   | 黄婵君                         |
| 电话：    | 0755-82943666               |
| 传真：    | 0755-83734343               |



|         |   |
|---------|---|
| 客户服务电话: | 4008888111; 95565   |
| 网址:     | <a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a> |

**(5) 广发证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 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:   | 广州市天河区马场路26号广发证券大厦  |
| 法定代表人:  | 林传辉   |
| 联系人:    | 黄岚  |
| 电话:     | 020-87555888  |
| 传真:     | 020-87555305  |
| 客户服务电话: | 95575、020-95575 或致电各地营业网点                                 |
| 网址:     | <a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a> |

**(6) 中信证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座                                       |
| 办公地址:   | 北京朝阳区新源南路6号京城大厦   |
| 法定代表人:  | 张佑君   |
| 联系人:    | 杜杰  |
| 电话:     | 010-60833889  |
| 传真:     | 010-84865560  |
| 客户服务电话: | 400-889-5548/95548  |
| 网址:     | <a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a> |

**(7) 中国银河证券股份有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 北京市西城区金融大街35号2-6层  |
| 办公地址:   | 北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦  |
| 法定代表人:  | 陈共炎  |
| 联系人:    | 辛国政  |
| 电话:     | 010-80928123   |
| 客户服务电话: | 4008-888-888 或 95551   |
| 网址:     | <a href="http://www.chinastock.com.cn/">http:// www.chinastock.com.cn/</a> |

**(8) 海通证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市淮海中路98号  |
| 办公地址:   | 上海市广东路689号海通证券大厦  |
| 法定代表人:  | 周杰  |
| 联系人:    | 李笑鸣   |
| 电话:     | 021-23219275  |
| 传真:     | 021-63602722  |
| 客户服务电话: | 95553   |
| 网址:     | <a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a> |

**(9) 申万宏源证券有限公司**

|       |                  |
|-------|------------------|
| 注册地址: | 上海市徐汇区长乐路989号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                  |
| 联系人:    | 陈宇                   |
| 电话:     | 021-33388252         |
| 传真:     | 021-33388224         |
| 客户服务电话: | 95523 或 4008895523   |
| 网址:     | www.swhysc.com       |

**(10) 兴业证券股份有限公司**

|         |                                |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址:   | 福州市湖东路 268 号                   |
| 办公地址:   | 上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层 |
| 法定代表人:  | 杨华辉                            |
| 联系人:    | 乔琳雪                            |
| 电话:     | 021-38565547                   |
| 传真:     | 021-38565783                   |
| 客户服务电话: | 4008888123/95562               |
| 网址:     | http://www.xyzq.com.cn/        |

**(11) 安信证券股份有限公司**

|         |                                       |
|---------|---------------------------------------|
| 注册地址:   | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 办公地址:   | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 法定代表人:  | 黄炎勋                                   |
| 联系人:    | 刘志斌                                   |
| 电话:     | 0755-82558323                         |
| 传真:     | 0755-82558355                         |
| 客户服务电话: | 95517                                 |
| 网址:     | http://www.essence.com.cn             |

**(12) 湘财证券股份有限公司**

|         |                                     |
|---------|-------------------------------------|
| 注册地址:   | 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 |
| 办公地址:   | 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 |
| 法定代表人:  | 孙永祥                                 |
| 联系人:    | 江恩前                                 |
| 电话:     | 021-38784580-8920                   |
| 客户服务电话: | 95351                               |
| 网址:     | http://www.xcsc.com                 |

**(13) 中信证券（山东）有限责任公司**

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

|         |   |
|---------|---|
| 办公地址:   | 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东 2、5 层  |
| 法定代表人:  | 冯恩新   |
| 联系人:    | 孙秋月   |
| 电话:     | 0532-85022026   |
| 传真:     | 0532-85022605   |
| 客户服务电话: | 95548   |
| 网址:     | <a href="http://www.cs.ecitic.com/newsite/">http://www.cs.ecitic.com/newsite/</a> |

**(14) 东兴证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市西城区金融大街 5 号 (新盛大厦) 12、15 层                         |
| 办公地址:   | 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层                        |
| 法定代表人:  | 魏庆华   |
| 联系人:    | 郑旷怡   |
| 电话:     | 010-66559039  |
| 传真:     | 010-66555133  |
| 客户服务电话: | 95309   |
| 网址:     | <a href="http://www.dxzq.net">http://www.dxzq.net</a> |

**(15) 东吴证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江苏省苏州市翠园路 181 号   |
| 办公地址:   | 江苏省苏州市星阳街 5 号   |
| 法定代表人:  | 范力  |
| 联系人:    | 陆晓  |
| 电话:     | 0512-62938521   |
| 传真:     | 0512-65588021   |
| 客户服务电话: | 4008601555  |
| 网址:     | <a href="http://www.dwjq.com.cn">http://www.dwjq.com.cn</a> |

**(16) 方正证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层  |
| 办公地址:   | 湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层  |
| 法定代表人:  | 施华  |
| 联系人:    | 胡创  |
| 电话:     | 010-56437060  |
| 传真:     | 0731-85832214   |
| 客户服务电话: | 95571   |
| 网址:     | <a href="http://www.foundersec.com">http://www.foundersec.com</a> |

**(17) 中信证券华南股份有限公司**

|        |                                    |
|--------|------------------------------------|
| 注册地址:  | 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 |
| 办公地址:  | 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 |
| 法定代表人: | 胡伏云                                |

|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 宋丽雪   |
| 电话:     | 020-88836999  |
| 传真:     | 020-88836984  |
| 客户服务电话: | 95548   |
| 网址:     | <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a> |

**(18) 东北证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 长春市生态大街 6666 号                                      |
| 办公地址:   | 长春市生态大街 6666 号                                      |
| 法定代表人:  | 李福春   |
| 联系人:    | 安岩岩   |
| 电话:     | 0431-85096517                                       |
| 传真:     | 0431-85096795                                       |
| 客户服务电话: | 95360   |
| 网址:     | <a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a> |

**(19) 浙商证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 浙江省杭州市江干区五星路 201 号  |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市江干区四季青街道五星路 201 号浙商证券 5 楼                                   |
| 法定代表人:  | 吴承根   |
| 联系人:    | 胡相斌   |
| 电话:     | 0571-87902239   |
| 传真:     | 0571-87901913   |
| 客户服务电话: | 95345   |
| 网址:     | <a href="http://www.stocke.com.cn/">http://www.stocke.com.cn/</a> |

**(20) 东海证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江苏省常州延陵西路 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   |
| 联系人:    | 王一彦   |
| 电话:     | 021-20333333  |
| 传真:     | 021-50498825  |
| 客户服务电话: | 95531; 4008888588   |
| 网址:     | <a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a> |

**(21) 恒泰证券股份有限公司**

|        |   |
|--------|---|
| 注册地址:  | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼 |
| 办公地址:  | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼 |
| 法定代表人: | 庞介民                                     |
| 联系人:   | 熊丽                                      |

|         |   |
|---------|---|
| 电话:     | 0471-4972675  |
| 传真:     | 0471-4930707  |
| 客户服务电话: | 400-196-6188  |
| 网址:     | <a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a> |

**(22) 国盛证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江西省南昌市新建区子实路 1589 号                                       |
| 办公地址:   | 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦                             |
| 法定代表人:  | 徐丽峰   |
| 联系人:    | 占文驰   |
| 电话:     | 0791-86283372   |
| 传真:     | 0791-6289395  |
| 客户服务电话: | 956080  |
| 网址:     | <a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a> |

**(23) 华西证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                     |
| 办公地址:   | 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                     |
| 法定代表人:  | 杨炯洋   |
| 联系人:    | 赵静静   |
| 电话:     | 010-58124967  |
| 传真:     | 028-86150040  |
| 客户服务电话: | 95584   |
| 网址:     | <a href="http://www.hxl68.com.cn">http://www.hxl68.com.cn</a> |

**(24) 申万宏源西部证券有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室             |
| 办公地址:   | 北京市西城区太平桥大街 19 号  |
| 法定代表人:  | 王献军   |
| 联系人:    | 陈宇  |
| 电话:     | 021-3338825   |
| 传真:     | 021-33388224  |
| 客户服务电话: | 4008000562  |
| 网址:     | <a href="http://www.hysec.com">http://www.hysec.com</a> |

**(25) 中泰证券股份有限公司**

|        |                     |
|--------|---------------------|
| 注册地址:  | 山东省济南市经十路 20518 号   |
| 办公地址:  | 山东省济南市经七路 86 号 23 层 |
| 法定代表人: | 李玮                  |
| 联系人:   | 朱琴                  |
| 电话:    | 021-20315161        |
| 传真:    | 0531-68889357       |

|         |                |
|---------|----------------|
| 客户服务电话: | 95538          |
| 网址:     | www.zts.com.cn |

**(26) 中国中金财富证券有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 |
| 办公地址:   | 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层  |
| 法定代表人:  | 高涛   |
| 联系人:    | 万玉琳  |
| 电话:     | 0755-82026907  |
| 传真:     | 0755-82026539  |
| 客户服务电话: | 4006008008/95532   |
| 网址:     | http://www.china-invs.cn/  |

**(27) 财达证券股份有限公司**

|         |                                    |
|---------|------------------------------------|
| 注册地址:   | 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 |
| 办公地址:   | 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层 |
| 法定代表人:  | 翟建强                                |
| 联系人:    | 刘亚静                                |
| 电话:     | 0311-66006393                      |
| 传真:     | 0311-66006249                      |
| 客户服务电话: | 4006128888                         |
| 网址:     | http://www.S10000.com              |

**(28) 天风证券股份有限公司**

|         |                                |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址:   | 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 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                             |
| 联系人:    | 王雅薇                            |
| 电话:     | 027-87107535                   |
| 客户服务电话: | 400-800-5000/ 95391            |
| 网址:     | http://www.tfzq.com/           |

**(29) 华创证券有限责任公司**

|        |                      |
|--------|----------------------|
| 注册地址:  | 贵州省贵阳市               |
| 办公地址:  | 贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦 |
| 法定代表人: | 陶永泽                  |
| 联系人:   | 郭佳来                  |
| 电话:    | 021-60762618         |

|         |   |
|---------|---|
| 传真:     | 021-60762700  |
| 客户服务电话: | 4008666689  |
| 网址:     | <a href="http://www.hczq.com/">http://www.hczq.com/</a> |

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：0755-25946013

传真：0755-25987122

联系人：严峰

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021- 51150298

传真：021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、刘翠

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

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

### 一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并经中国证监会 2021 年 02 月 03 日证监许可[2021]397 号文准予募集注册。

本基金募集期自 2021 年 06 月 15 日至 2021 年 07 月 09 日期间，基金份额共募集 339,124,083.00 份（含利息结转的份额），募集有效认购总户数为 7,657 户。

本基金的运作方式为交易型开放式，存续期间为不定期。

### 二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2021 年 07 月 15 日正式生效。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。



## 第七部分 基金的份额折算与变更登记

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。

### 一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

### 二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（因尾数处理而产生的损益不视为实质性影响）。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### 三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

## 第八部分 基金份额的上市交易

### 一、基金上市

本基金于 2021 年 07 月 26 日起在上海证券交易所上市交易，交易代码：516580。

### 二、基金份额的上市交易

基金份额在上海证券交易所的上市交易应遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### 三、终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起依照《信息披露办法》发布基金终止上市公告。

若因上述 1、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，而无需召开基金份额持有人大会。届时，基金管理人可变更本基金的登记结算机构并相应调整申购赎回业务规则，同时，基金管理人可按照《信息披露办法》的规定，公告变更后的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并或选取其他合适的指数作为标的指数。

### 四、基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一个交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，中证指数有限公司在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基

基金份额参考净值，并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

(1) 基金份额参考净值 (IOPV) 的计算公式:

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购赎回单位所对应的基金份额

(2) 基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。

(3) 上海证券交易所和基金管理人可以调整基金份额参考净值的计算方法及保留的小数点位数，并予以公告。

**五、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在其他证券交易所同时挂牌交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。**

**六、相关法律法规、中国证监会、登记机构及上海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，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。**

## 第九部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金投资人应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。基金管理人在确定、变更申购赎回代理券商名单时，均应在公告之前报请上海证券交易所认可。

在法律法规、基金合同及未来条件允许的情况下，基金管理人直销机构可以开通申购赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金已于 2021 年 07 月 26 日开放日常申购、赎回业务。

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

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

### 三、申购与赎回的原则

- 1、“份额申购、份额赎回”原则，即申购、赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《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

投资人必须根据申购、赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的基金份额余额和现金，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，则赎回申请不成立。

申购、赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购、赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金投资人申购的基金份额当日起可卖出，投资人赎回获得的股票当日起可卖出。

如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在本招募说明书中进行更新。

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定。对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，基金份额、上海证券交易所上市的成份股的现金替代、深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式，申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管

理人和基金托管人。投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记机构、基金管理人、申购赎回代理券商之间在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据相关业务规则的有关规定和其他相关约定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购、赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额或现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

基金管理人、登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介公告。

本基金获批后，若上海证券交易所和中国证券登记结算有限公司针对跨市场交易型开放式指数证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的基金合同和招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。

#### 五、申购与赎回的数额限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金的最小申购赎回单位为 100 万份。

2、基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限，具体规定详见申购、赎回清单。

3、基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人可以采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基

金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定数量或比例等限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告（其中上述第 2、3、4 条基金管理人必须于前一交易日设定并在当日基金申购、赎回清单上公布，而不必在规定媒介上公告也无须报中国证监会备案）。

## 六、申购与赎回的对价和费用

1、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。申购、赎回清单的内容与格式见下文“七、申购赎回清单的内容与格式”。

3、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

5、基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

## 七、申购赎回清单的内容与格式

### 1、申购赎回清单的内容

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

### 2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

### 3、现金替代相关内容

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

现金替代分为 4 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

禁止现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

退补现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资人进行退款或补款。

#### （1）关于可以现金替代

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

2) 替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

其中，“该证券参考价格” 定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”。

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

收取申购现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该部分证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

3) 替代金额的处理程序如下：

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



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

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

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

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

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

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

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

公式中，“该证券参考价格”的确定原则与可以现金替代情况下，替代金额的计算公式中的该证券参考价格确定原则相同。基金份额参考净值目前为本基金前一交易日除权除息后的收盘价，如果基金份额参考净值计算方式发生变化，以上海证券交易所发布的基金份额参考净值为准。

## (2) 关于必须现金替代

1) 适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票，或因法律法规限制投资的成份证券，或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

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

### (3) 关于退补现金替代

1) 适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证新能源指数中深圳证券交易所股票。

2) 替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × (1 + 申购现金替代溢价比例)。

赎回的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × (1 - 赎回现金替代折价比例)。

### 3) 替代金额的处理程序

对退补现金替代而言，申购时收取申购现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

对退补现金替代而言，赎回时扣除赎回现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定赎回现金替代折价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依

次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上海证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特殊情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还

申购投资者或申购投资者应补交的款项,以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入(卖出价格扣除交易费用)加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日(T日)后至T+2日(若在特例情况下,则为T日起第20个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日(若在特例情况下,则为T日起第21个交易日),基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人,相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

#### (4) 预估现金部分相关内容

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

T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分,其计算公式为:

$$T \text{ 日 预 估 现 金 部 分 } = T - 1 \text{ 日 最 小 申 购 赎 回 单 位 的 基 金 资 产 净 值 } - ( \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 必 须 用 现 金 替 代 的 固 定 替 代 金 额 总 额 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 退 补 现 金 替 代 成 份 证 券 的 数 量 与 该 证 券 调 整 后 } T \text{ 日 开 盘 参 考 价 相 乘 之 和 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 可 以 用 现 金 替 代 的 所 有 成 份 证 券 的 数 量 与 该 证 券 调 整 后 } T \text{ 日 开 盘 参 考 价 乘 积 之 和 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 禁 止 用 现 金 替 代 的 所 有 成 份 证 券 的 数 量 与 该 证 券 调 整 后 } T \text{ 日 开 盘 参 考 价 乘 积 之 和 } )$$

其中,该证券调整后T日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外,若T日为基金分红除息日,则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需要扣减相应的收益分配数额。

预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

#### (5) 现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告,其计算公式为:

$$T \text{ 日 现 金 差 额 } = T \text{ 日 最 小 申 购 赎 回 单 位 的 基 金 资 产 净 值 } - ( \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 必 须 用 现 金 替 代 的 固 定 替 代 金 额 总 额 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 退 补 现 金 替 代 成 份 证 券 的 数 量 与 } T \text{ 日 收 盘 价 相 乘 之 和 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 可 以 用 现 金 替 代 的 所 有 成 份 证 券 的 数 量 与 其 } T \text{ 日 收 盘 价 乘 积 之 和 } + \text{ 申 购 赎 回 清 单 中 禁 止 用 现 金 替 代 的 所 有 成 份 证 券 的 数 量 与 其 } T \text{ 日 收 盘 价 乘 积 之 和 } )$$

T日投资人申购、赎回基金份额时,需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时,如现金差额为正数,则投

投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### (6) 申购赎回清单的格式

| 基本信息               |                       |      |        |            |            |        |
|--------------------|-----------------------|------|--------|------------|------------|--------|
| 最新公告日期             | 20XX 年 月 日            |      |        |            |            |        |
| 基金名称               | 博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金 |      |        |            |            |        |
| 基金管理公司名称           | 博时基金管理有限公司            |      |        |            |            |        |
| 一级市场基金代码           | XXXXXX                |      |        |            |            |        |
| T-1 日信息内容          |                       |      |        |            |            |        |
| 现金差额（单位：元）         | XXXX. XX              |      |        |            |            |        |
| 最小申购赎回单位资产净值（单位：元） | XXXX. XX              |      |        |            |            |        |
| 基金份额净值（单位：元）       | X. XXXX               |      |        |            |            |        |
| T 日信息内容            |                       |      |        |            |            |        |
| 预估现金部分（单位：元）       | XXXX. XX              |      |        |            |            |        |
| 可以现金替代比例上限         | 无                     |      |        |            |            |        |
| 申购上限               | 无                     |      |        |            |            |        |
| 赎回上限               | 无                     |      |        |            |            |        |
| 是否需要公布 IOPV        | 是                     |      |        |            |            |        |
| 最小申购赎回单位（单位：份）     | 1, 000, 000           |      |        |            |            |        |
| 申购、赎回的允许情况         | 申购、赎回皆允许              |      |        |            |            |        |
| T 日成份股信息内容         |                       |      |        |            |            |        |
| 股票代码               | 股票简称                  | 股票数量 | 现金替代标志 | 申购现金替代溢价比例 | 赎回现金替代折价比例 | 固定替代金额 |

若上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的申购申请；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；

- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购、赎回清单编制错误；
- 5、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；
- 6、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购；或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购份额上限的；
- 8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 9、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。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。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

#### **九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形及处理方式**

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对价：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；
- 5、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回；或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不

当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形；

7、本基金当日总赎回份额达到基金管理人所设定的上限；

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

9、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应按规定报中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付，基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销，如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

## 十、基金份额折算

为提高交易便利或根据需要（如变更标的指数），基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算后，基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

## 十一、基金份额拆分与合并

基金成立后，在法律法规规定的范围内，在基金管理人与基金托管人协商一致的情况下，本基金可实施基金份额拆分或合并。

基金份额拆分或合并是在保持现有基金份额持有人资产总值不变的前提下，改变基金份额净值和持有基金份额的对应关系，是重新列示基金资产的一种方式。基金份额拆分或合并对基金份额持有人的权益无实质性影响。

## 十二、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，如对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响，基金管理人经履行相关程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的证券交易所以

外的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### 十三、基金的非交易过户、冻结、解冻等其他业务

基金的登记机构可依据其业务规则，受理基金的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

### 十四、联接基金的特殊申购

若基金管理人推出以本基金为目标 ETF 的联接基金，本基金可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，不收取申购费用。

### 十五、其他

1、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购（或集中申购，具体表述以监管最终业务规则为准）。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。

2、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

3、对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。



## 第十部分 基金的投资

### 一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

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

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

### 三、投资策略

#### 1、组合复制策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方

法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

## 2、债券（除可转换债券）投资策略

本基金债券投资组合将着重考虑基金的流动性管理及策略性投资的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

## 3、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 4、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。

## 5、可转换债券、可交换债券投资策略

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金着重对可转换债券所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，并结合基金管理人可转债评级系统对可转换债券投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及

目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。

#### 6、衍生品投资策略

##### (1) 股指期货、国债期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,改善组合的风险收益特性。

##### (2) 股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

本基金投资股票期权,基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范股票期权投资的风险。

#### 7、融资和转融通证券出借

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资和转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。本基金将根据市场情况、投资者类型和结构、本基金的历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素,合理确定出借证券的范围和品类。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来在法律法规允许的前提下,本基金将依据法律法规的相关规定参与融券业务。

未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标的前提下,相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

### 四、投资管理流程

#### 1、投资决策依据

有关法律法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

#### 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负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策，以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整及基金每日申购赎回清单的编制等决策。

### 3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合，构成了本基金的投资管理程序。

(1) 研究支持。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果，开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建。结合研究报告，基金经理主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

(4) 交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

(6) 组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书更新中予以公告。

## 五、投资组合管理

### 1、投资组合的构建

基金管理人构建基金投资组合的过程主要分为三个步骤：确定目标组合、制定建仓策略，以及逐步调整组合。

(1) 确定目标组合。基金管理人主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合。

(2) 制定建仓策略。基金经理依据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素所做的分析，制定合理的建仓策略。

(3) 逐步调整组合。基金经理在规定时间内，采取适当的手段和措施，对实际投资组合进行动态调整，直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

### 2、投资组合的日常管理

本基金投资组合的日常管理内容主要包括以下几个方面：

(1) 标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析。跟踪分析标的指数成份股公司行为等信息，如股本变化、分红、停牌、复牌，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而分析是否需要调整投资组合，为投资决策提供依据。

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

(3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析。跟踪分析每日基金申购赎回信息，分析这些信息对投资组合的影响。

(4) 投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析。基金经理跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因，并对拟调整的成份股的流动性进行分析。

(5) 投资组合调整。使用量化投资分析模型，寻找出将实际投资组合调整为所追求的目标组合的最优方案，确定组合交易计划；如标的指数成份股调整、成份股公司发生兼并、收购和重组等重大事件，由基金经理召集会议，决定基金的操作策略；进一步调整投资组合，达到所追求的目标组合的持仓结构。

(6) 基金每日申购赎回清单的制作。基金经理以 T-1 日的指数成份股的构成或者实际持仓股票的构成及相应权重为基础，并考虑 T 日将发生的上市公司变动等情况，制作 T 日基金申购赎回清单并予以公告。

### 3、投资组合的定期管理

本基金投资组合的定期管理内容主要包括以下几个方面：

#### (1) 每月

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

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

#### (2) 每半年

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

## 六、标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为中证新能源指数。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证新能源指数收益率。

中证新能源指数由中证指数公司编制，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源产业相关上市公司的整体表现。

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，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

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。

若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

## 七、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证新能源指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## 八、投资限制与禁止行为

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

(9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(10) 本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(11) 本基金参与转融通证券出借交易应当符合以下要求：

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(12) 本基金参与股票期权交易的，需遵守下列规定：

1) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2) 开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

4) 基金投资股票期权应符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(13) 本基金参与股指期货和国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；



4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

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

(14) 本基金投资流通受限证券，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；

(15) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(17) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（2）、（7）、（11）、（15）、（16）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

#### **九、基金管理人代表基金行使股东或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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 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。

#### **十、基金投资组合报告**

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 09 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### **1 报告期末基金资产组合情况**

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 184,278,431.55 | 96.93        |
|    | 其中：股票             | 184,278,431.55 | 96.93        |
| 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      | 5,425,278.80   | 2.85         |
| 8  | 其他各项资产            | 407,936.05     | 0.21         |
| 9  | 合计                | 190,111,646.40 | 100.00       |

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 167,417,394.35 | 89.28        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,701,164.00  | 6.77         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 488,785.20     | 0.26         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 182,988.00     | 0.10         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
| S | 综合 | 3,487,320.00   | 1.86  |
|   | 合计 | 184,277,651.55 | 98.27 |

### 3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 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  | 300750 | 宁德时代 | 32,675  | 17,178,227.75 | 9.16         |
| 2  | 601012 | 隆基股份 | 198,500 | 16,372,280.00 | 8.73         |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 65,808  | 9,764,591.04  | 5.21         |
| 4  | 600438 | 通威股份 | 174,200 | 8,873,748.00  | 4.73         |
| 5  | 002460 | 赣锋锂业 | 51,850  | 8,448,439.00  | 4.51         |
| 6  | 300014 | 亿纬锂能 | 73,100  | 7,239,093.00  | 3.86         |
| 7  | 002129 | 中环股份 | 136,900 | 6,279,603.00  | 3.35         |
| 8  | 603799 | 华友钴业 | 54,400  | 5,624,960.00  | 3.00         |
| 9  | 002709 | 天赐材料 | 36,500  | 5,552,380.00  | 2.96         |
| 10 | 300450 | 先导智能 | 60,500  | 4,224,110.00  | 2.25         |

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除华友钴业(603799)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2021年2月10日，因信息披露虚假或严重误导性陈述，未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责等行为，上海证券交易所对浙江华友钴业股份有限公司处以监管关注措施。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资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   | 362,010.70 |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,028.86   |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,565.01   |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | 42,331.48  |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 407,936.05 |

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十一部分 基金的业绩

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

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 期间                    | ①净值增长率 | ②净值增长率标准差 | ③业绩比较基准收益率 | ④业绩比较基准收益率标准差 | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2021.07.15-2021.09.30 | 5.28%  | 2.57%     | 9.77%      | 2.81%         | -4.49% | -0.24% |

## 第十二部分 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、基金应收款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基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十三部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

### 四、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)确定公允价值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事



件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，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）流通受限的股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行

间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

8、本基金参与转融通证券出借业务的，将按照法律法规及行业协会的相关规定进行估值。

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方法估值。

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。

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

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

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 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。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

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

## 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 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，或证券/期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等机构发送的数据错误、遗漏等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；
- 3、当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配；
- 4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 5、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 6、法律法规、监管机关、证券交易所或基金登记机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

### 二、基金收益分配比例及金额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率、标的指数同期增长率。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率 = 基金份额净值增长率 - 标的指数同期增长率。

基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算上述指标。

收益评价日日期以本基金日后相关公告为准。

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

- 3、根据前述可供分配利润及收益分配比例计算收益分配金额。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### **四、收益分配方案的确定、公告与实施**

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

#### **五、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## 第十五部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的证券、期货、股票期权交易费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 8、基金上市费及年费、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、收益分配中发生的费用；
- 10、基金财产投资运营过程中的增值税；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费



E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月初3个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,应及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第3-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、指数许可使用基点费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用基点费计提方法支付指数许可使用基点费,该指数许可使用基点费由基金管理人承担,不得从基金财产中列支。

如果指数许可使用基点费的计算方法、费率、支付方式和费用承担方等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用基点费;

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十六部分 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基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按规定在规定媒介公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）和《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

5、基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前的3个工作日前在规定报刊及网站上公告。

#### （五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

#### （六）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

#### （七）基金净值信息

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站公告一次基金份额净值和基金份额累计净值；

在基金份额上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

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

#### （八）基金份额申购、赎回清单

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

（九）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于规定网站上，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符合《证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

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

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

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

#### （十）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应按规定编制临时报告书，并登载在规定的报刊和规定网站上。

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定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易；

21、调整基金份额类别的设置；

22、基金推出新业务或服务；

23、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

24、连续 30 个工作日、40 个工作日及 45 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；

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

#### （十一）澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告基金上市交易的证券交易所。

#### （十二）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。

#### （十三）清算报告

基金合同出现终止情形的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (十四) 基金投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券的,基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### (十五) 基金投资股指期货、国债期货、股票期权的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金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、国债期货、股票期权交易情况,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、国债期货、股票期权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。

#### (十六) 参与融资和转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与融资和转融通证券出借业务的,基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资和转融通证券出借业务的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等,并就转融通证券出借业务在报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### (十七) 基金投资流通受限证券的信息披露

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

#### (十八) 中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规以及证券交易所的自律管理规则的规定。



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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致确认后，应当暂停估值；
- 4、法律法规、基金合同认定的或中国证监会规定的其他情形。

## 第十八部分 风险揭示

本基金管理人在总结、借鉴基金管理人旗下已有开放式基金（包括ETF基金）风险管理成熟经验的基础上，针对本基金的特点，确立科学的风险管理理念，建立相应的风险管理体系，对本基金整个投资过程进行有效的风险监控，为基金份额持有人谋取标的指数所表征的市场平均水平的投资收益。

投资于本基金的主要风险包括以下几个方面：

### 一、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

### 二、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

### 三、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

3、成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

4、由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

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

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

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

#### 四、流动性风险

##### 1、本基金交易方式带来的流动性风险

①本基金最小申购、赎回单位设置较高，中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

②基金将在上海证券交易所上市交易，但不保证市场交易一定活跃；基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

③尽管由于投资者可以进行申购、赎回，基金一般不会持续出现大幅折溢价情况。但是，基金的二级市场交易价格受市场供求的影响，可能高于（称为溢价）或低于（称为折价）基金份额净值。

##### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括依法发行上市的股票、股指期货、股票期权、债券、国债期货、货币市场工具、债券回购、资产支持证券等。投资交易均在依法设立的正规市场中进行，所投市场和资产方面的整体流动性较高。同时，本基金通过投资限制对各类资产的投资比例、期限、评级、杠杆和集中度进行了控制，并严格控制了主动投资于流动性受限资产的比例上限，整体持仓资产的流动性风险较低。

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

本基金属于开放式基金的一种特殊类型，在申赎机制方面为投资者提供了场内交易以及场内申赎等多种方式，且遇持仓停牌证券可通过现金替代的方式进行应对，给投资者获取流动性提供了极大的便利。同时，本基金基于客户集中度控制和赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

#### 五、标的指数变更的风险

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

#### **六、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，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。因此，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。

#### **七、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险**

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### **八、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险**

中证指数有限公司在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值，并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值与实时的基金份额净值可能存在差异，基金份额参考净值计算可能出现错误，投资人若参考基金份额参考净值进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

#### **九、退市风险**

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

#### **十、投资人申购失败的风险**

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

#### **十一、投资人赎回失败的风险**

投资人在提出场内份额赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致场内份额赎回失败的情形。

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

#### **十二、退补现金替代方式的风险**

本基金在申购赎回环节的“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格及基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

#### **十三、基金场内份额赎回对价的变现风险**

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

#### **十四、第三方机构服务的风险**

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

- 1、申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。
- 2、登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资人带来风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3、证券交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

### 十五、股指期货投资风险

#### 1、杠杆风险

股指期货投资具有高杠杆特性，因此会放大基础资产所产生的盈利或损失，加大本基金收益的波动性。

#### 2、基差风险

基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若本基金运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

#### 3、合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

#### 4、模型风险

股指期货合约属于虚拟投资品种，投资过程中需要通过模型进行风险定价，当投资人员使用了错误模型或者选择了不当的参数，会导致对风险或交易价格的估计错误而造成损失，损害本基金的投资收益。

### 十六、国债期货投资风险

本基金的一部分资产将可能投资于国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与可预防性等特征。其风险主要有由利率波动原因造成的市场价格风险、由宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、由市场和资金流动性原因引起的流动性风险、由交易制度不完善而引发的制度性风险以及由技术系统故障及操作失误造成的技术系统风险等。

### 十七、资产支持证券（ABS）的风险

资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

## 十八、新股申购风险

本基金可参与新股申购，新股发行政策、新股发行机制等影响新股发行的因素变动将会影响本基金的风险收益水平；新股配售比例、中签率的不确定性，或其他发售方式的不确定性以及上市后市场表现的不确定性使得本基金的投资收益不确定性有增加的风险。

## 十九、股票期权风险

**流动性风险：**由于股票期权合约众多，交易较为分散，股票期权市场的流动性一般较期货市场要低，尤其是深度实值和虚值的股票期权，成交量稀少，持有这些股票期权的投资者容易遇到无法成交、平仓出局的局面。

**价格风险：**股票期权买方的价格风险即为他所付出的权利金，风险具有确定性。股票期权卖方的价格风险不定，不过其所收取的权利金可以提供相应保护，当发生亏损时，可以抵消部分损失。

**操作风险：**操作风险是指由于管理不善或者制度执行出现问题等原因所导致的风险。股票期权作为一种衍生品，虽然可以用来管理风险，但若使用不当，也会产生巨额损失。

## 二十、融资交易和转融通证券出借业务的主要风险

本基金可参与融资及转融通证券出借业务。融资及转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。其中，转融通证券出借业务的流动性风险是指基金面临大额赎回时可能因证券出借原因无法及时变现支付赎回款项的风险；信用风险是指证券出借对手方无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用；市场风险是指证券出借期间无法正常处置该证券的风险。

基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险。

## 二十一、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已

在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 二十二、管理风险与操作风险

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

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

## 二十三、技术风险

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

## 二十四、不可抗力

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

## 二十五、自动清算的风险

本基金基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。因此本基金有面临自动清算的风险。



## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

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

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

#### **四、清算费用**

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

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

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

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(4) 交纳基金认购款项和认购股票、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(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、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、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、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 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和转融通证券出借业务；

(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、相关证券交易所及登记机构相关业务规则的规定及基金合同的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则;

(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。

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

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

(2) 办理基金备案手续;

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《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,确定基金份额申购、赎回对价,编制申购赎回清单;

(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、中期和年度基金报告;

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定；

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定；

(12) 保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

若以本基金为目标 ETF，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金基



基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### （一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；

(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(5) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；

(6) 经履行相关程序后，基金推出新业务或服务；

(7) 本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；

(8) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(9) 进行基金份额的拆分与合并；

(10) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

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

## (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定外,转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在规定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算



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

2、基金财产清算小组成员：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定的报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

#### 四、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如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深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）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、代销机构办公场所查阅。

## 第二十一部分 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：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人：江向阳

设立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：0755-83169999

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

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

法定代表人：王常青

成立时间：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字【2005】112 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 77.57 亿元

基金托管资格批文及文号：证监许可【2015】219 号

存续期间：持续经营

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；保险兼业代理业务。

### 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对基金管理人的下列投资运作进行监督：

## 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

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

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

## 2、对基金投融资比例进行监督。

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

(9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;

(10) 本基金参与融资的,在任何交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

(11) 本基金参与转融通证券出借交易应当符合以下要求:

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的30%,出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%;

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元;

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算;

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条规定的,基金管理人不得新增出借业务;

(12) 本基金参与股票期权交易的,需遵守下列规定:

1) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;

2) 开仓卖出认购股票期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽股票期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

4) 基金投资股票期权应符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

(13) 本基金参与股指期货和国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

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

(14) 本基金投资流通受限证券，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；

(15) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(17) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（2）、（7）、（11）、（15）、（16）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

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

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

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

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

(六) 本基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，完善业务流程，有效防范和控制风险。基金托管人将对基金参与转融通证券出借业务进行监督和复核。

### 三、基金管理人<sub>对</sub>基金托管人的业务核查

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

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在上述规定限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在上述规定限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

3、基金托管人按照规定开设基金财产的托管账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。

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

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

##### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票按基金合同约定的估值方法计算的价值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签章方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金托管账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。募集期间募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户。

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事宜。



### （三）基金的托管账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户，账户名称以实际开立为准。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

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

4、基金托管账户的管理应符合法律法规的有关规定。

### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

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

### （五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

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

6、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。

### （六）债券托管账户的开设和管理

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

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年,法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件并保证其真实性及其与原件的完全一致性,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### (一) 基金资产净值的计算和复核

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。

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

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

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当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；当错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。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。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。

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

7、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等机构发送的数据错误、遗漏等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

## （二）基金会计核算

### 1、基金账册的建立

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

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并在上半年结束之日起两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于在每年结束之日起三个月内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上签章确认，或

出具签章版复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### （三）基金份额持有人名册的保管

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

## 七、适用法律与争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，本协议各方当事人应尽量通过协商、调解途径解决。如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费和律师费由败诉方承担。

争议处理期间，本协议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》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律(为协议之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更

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

### (二) 托管协议的终止

发生以下情况,本托管协议应当终止:

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

### (三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

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

基金管理人提供的服务内容如下：

### 一、客户服务电话

客户服务中心自动语音系统提供每周七天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可以通过电话查询基金份额净值。同时，客服中心提供工作日每天 9:00-21:00、节假日（十一和春节除外）9:00-17:00 的电话人工服务。

博时一线通：95105568（免长途话费）

### 二、网上客户服务中心

网上客户服务为投资人提供查询服务、资讯服务以及在线咨询的平台。登陆网站后，投资人可以查询基金相关信息，享受资讯服务；投资人还可以使用“在线客服”功能进行在线咨询以及查询热点问题及其解答，并提交投诉与建议。

基金管理人网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)

电子邮箱：[service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)

### 三、客户投诉处理

投资者可以通过博时基金网站、客服中心 IVR 自动语音留言、客服中心电话人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人提供的服务进行投诉。投资者还可以通过发售代理机构、申购赎回代理券商的服务电话对该代理机构提供的服务进行投诉。

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

## 第二十三部分 其他应披露的事项

（一）、 2021年11月05日，我公司公告了《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增财达证券为申购、赎回代办券商的公告》；

（二）、 2021年10月27日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金2021年第3季度报告》；

（三）、 2021年10月22日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（四）、 2021年10月15日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（五）、 2021年10月13日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（六）、 2021年09月30日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告》；

（七）、 2021年09月28日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210928》；

（八）、 2021年09月08日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（九）、 2021年09月07日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十）、 2021年09月01日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十一）、 2021年08月19日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十二）、 2021年07月26日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示公告》；

（十三）、 2021年07月24日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》；



(十四)、 2021年07月21日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》；

(十五)、 2021年07月16日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》；

(十六)、 2021年07月01日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告》；

(十七)、 2021年06月18日，我公司公告了《关于博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金延长募集时间的公告》；

(十八)、 2021年06月12日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购清单调整的提示公告》；

(十九)、 2021年06月01日，我公司公告了《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。投资人可在办公时间查阅；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。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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

## 第二十五部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会准予博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- (二) 《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 法律意见书
- (七) 中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

博时基金管理有限公司

2021年11月30日