

天弘中证新能源指数增强型证券投资基金  
招募说明书（更新）

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

日 期：二〇二二年七月十四日

## 重要提示

天弘中证新能源指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2021 年 11 月 1 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2021】3448 号）。

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，但中国证监会准予本基金募集注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于 2022 年 7 月 4 日正式生效。

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。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金并非保本基金，基金管理人并不能保证投资于本基金不会产生亏损。

基金管理人在此特别提示投资者：本基金存在法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长

期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,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,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“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,由投资者自行承担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本次更新招募说明书主要对本基金基金经理相关信息进行更新,上述内容更新截止日为 2022 年 7 月 13 日。

## 目 录

一、绪言 .....	5
二、释义 .....	6
三、基金管理人 .....	12
四、基金托管人 .....	23
五、相关服务机构 .....	26
六、基金的募集 .....	28
七、基金合同的生效 .....	34
八、基金份额的申购与赎回.....	35
九、基金的投资 .....	47
十、基金的财产 .....	57
十一、基金资产的估值 .....	58
十二、基金的收益与分配.....	64
十三、基金费用与税收 .....	66
十四、基金的会计与审计.....	69
十五、基金的信息披露 .....	70
十六、侧袋机制 .....	77
十七、风险揭示 .....	80
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	89
十九、基金合同的内容摘要.....	91
二十、基金托管协议的内容摘要.....	110
二十一、对基金份额持有人的服务.....	124
二十二、招募说明书存放及查阅方式.....	126
二十三、 标的指数的编制方法及指数信息查阅方式.....	127

---

二十四、备查文件 ..... 129

## 一、绪言

《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。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。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指天弘中证新能源指数增强型证券投资基金
- 2、基金管理人：指天弘基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指国信证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 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
- 11、《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
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，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》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

14、《流动性风险管理规定》：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

15、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

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

18、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

19、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

20、合格境外投资者：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》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外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

22、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

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指天弘基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务



协议，办理基金销售业务的机构

25、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为天弘基金管理有限公司或接受天弘基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

29、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

30、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

31、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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

36、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

37、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

38、《业务规则》：指《天弘基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

39、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

40、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

46、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出借证券，中国证券金融股份有限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

47、元：指人民币元

48、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

53、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

54、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

55、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

56、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

57、A 类基金份额：指在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

58、C 类基金份额：指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

59、标的指数：指中证新能源指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数

60、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

61、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

62、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

63、养老金客户：指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投

资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围

64、非养老金客户：指除养老金客户外的其他投资人

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦 23 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

成立日期：2004 年 11 月 8 日

法定代表人：韩歆毅

客服电话：95046

联系人：司媛

组织形式：有限责任公司

注册资本及股权结构

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164 号），于 2004 年 11 月 8 日成立。公司注册资本为人民币 5.143 亿元，股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员基本情况

韩歆毅先生，董事长，硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部执行总经理、阿里巴巴集团企业融资部资深总监，现任蚂蚁科技集团股份有限公司

首席财务官。

周志峰先生，董事，本科。历任方达律师事务所律师、律所合伙人。现任蚂蚁科技集团股份有限公司首席法务官、董事会秘书。

祖国明先生，董事，本科。历任中国证券市场研究设计中心工程师，和讯信息科技有限公司COO助理，浙江淘宝网络有限公司总监，支付宝（中国）网络技术有限公司北京分公司资深总监，现任蚂蚁科技集团股份有限公司金融机构战略合作部总经理。

张杰先生，董事，注册会计师、注册审计师。历任锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长、总经理，锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理，内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，鄂尔多斯市君正能源化工有限公司监事，乌海市神华君正实业有限责任公司监事会主席，内蒙古君正天原化工有限责任公司监事，连云港港口国际石化仓储有限公司董事，上海傲兴国际船舶管理有限公司监事，内蒙古君正互联网小额贷款有限公司董事长，现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事会秘书。

付岩先生，董事，本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司总经理助理、普惠金融总部总经理、普惠金融部总经理，天津国通股权投资基金管理有限公司董事、总经理，天津天信汇金资产管理有限公司董事长（法定代表人）、总经理，中车金租租赁有限公司董事。

郭树强先生，董事，总经理，硕士。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理。

张军先生，独立董事，博士。现任复旦大学经济学院院长。

贺强先生，独立董事，本科。现任中央财经大学金融学院教授。

孟路先生，独立董事，硕士。历任中国建设银行北京西四支行国际部副经理，中国建设银行北京长安支行副总经理，中国建设银行北京前门支行行长助理，中国建设银行北京开发区支行行长，中国民生银行轨道交通部总经理，贵州银行行长助理兼贵阳管理部总经理，福建海峡银行首席投资官兼上海金融业务研发中心、

资产合作管理部总裁，盈科创新资产管理有限公司联席总裁。现任上海铁林投资控股有限公司责任公司董事长兼总经理。

## 2、监事会成员基本情况

杨海军先生，监事，本科。历任北京证券有限责任公司深圳营业部总经理，联合证券有限责任公司交易管理部总经理，厦门联合信托投资有限责任公司上海证券部总经理，中泰信托有限责任公司证券部总经理、北京中心副总经理兼北京中心综合管理部总经理，上海实业城市开发集团有限公司深圳公司总经理兼融产结合推进办副主任，现任天津信托有限责任公司业务总监。

刘佳女士，监事，硕士。历任中国国际航空股份有限公司审计部审计经理，联想控股股份有限公司审计经理，现任内蒙古君正集团企业管理（北京）有限公司执行董事、经理，上海君正物流有限公司财务部副总经理。

李渊女士，监事，硕士。历任北京朗山律师事务所律师，现任芜湖高新投资有限公司法务总监。

付颖女士，监事，硕士。历任本公司内控合规部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管，现任本公司内控合规部总经理。

于洋先生，监事，博士。2011年7月加盟天弘基金管理有限公司，历任研究员、投资研究部总经理助理，现任股票投资研究部总经理助理、基金经理。

史明慧女士，监事，硕士。历任新华基金管理有限公司高级产品经理，北京新华富时资产管理有限公司部门总经理助理，2014年6月加盟天弘基金管理有限公司，历任高级产品经理，现任产品部负责人。

## 3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生，副总经理，硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理，北京宸星投资管理公司投资经理，兴业证券公司债券总部研究部经理，银华基金管理有限公司机构理财部高级经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司，现任公司副总经理、固定收益总监、资深基金经理。

周晓明先生，副总经理，硕士。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资

部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理。

熊军先生，副总经理，财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员，国家国有资产管理局主任科员、副处长，财政部干部教育中心副处长，全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司，任命为公司首席经济学家，现任公司副总经理。

朱海扬先生，副总经理，博士。历任中国太平洋人寿保险股份有限公司一级专务、副处长、太平洋养老保险公司筹备组成员，长江养老保险股份有限公司筹备组业务组副组长，市场发展部副总经理（主持工作）、销售管理部总经理、产品支持部总经理、养老金财富管理部总经理，安邦养老保险股份有限公司拟任总经理助理。2015年6月加盟本公司，历任养老金业务总监、总经理助理，现任公司副总经理。

童建林先生，督察长，本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管。2006年8月加盟本公司，历任基金会计、内控合规部副总经理、内控合规部总经理。现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

杨超先生，金融数学与计算硕士，12年证券从业经验。历任建信基金管理有限公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。历任天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2019年09月至2022年05月）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2019年12月至2021年08月）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019年12月至2021年08月）、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019年09月至2022年05月）、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020年08月至2021年06月）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经



理（2020年03月至2021年06月）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020年02月至2021年06月）、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金基金经理（2020年11月至2021年12月）、天弘中证光伏产业指数型发起式证券投资基金基金经理（2021年01月至2022年05月）、天弘中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年02月至2022年05月）、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年06月至2020年08月）、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年06月至2019年12月）、天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年06月至2019年09月）。现任本公司指数与数量投资部总经理、基金经理。天弘中证500指数增强型证券投资基金基金经理、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证科创创业50指数证券投资基金基金经理、天弘中证医药主题指数增强型证券投资基金基金经理、天弘中证高端装备制造指数增强型证券投资基金基金经理、天弘华证沪深港长期竞争力指数证券投资基金基金经理、天弘中证1000指数增强型证券投资基金基金经理、天弘MSCI中国A50互联互通指数证券投资基金基金经理、天弘新华沪港深新兴消费品牌指数证券投资基金基金经理、天弘中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金经理。

林心龙先生，光学工程专业硕士，7年证券从业经验。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理，2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。现任本公司基金经理。天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基

金基金经理、天弘中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理、天弘中证人工智能主题指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证沪港深物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金经理。

#### 5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生：本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、固定收益总监、基金经理。

熊军先生：本公司副总经理，投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。

邓强先生：首席风控官。

姜晓丽女士：固定收益业务总监、基金经理，兼任固定收益部、宏观研究部、混合资产部部门总经理。

于洋先生：股票投资研究部总经理助理，基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

##### 1、基金管理人遵守法律的承诺

本基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

基金管理人禁止性行为的承诺。

本基金管理人依法禁止从事以下行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

##### 2、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着勤勉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、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益。

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

（4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## （五）基金管理人的风险管理与内部控制制度

### 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所有的部门和岗位，涵盖所有风险类型，并贯穿于所有业务流程和业务环节；

（2）独立性原则：公司根据业务需要设立保持相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部门及审计部门，负责识别、监测、评估和报告公司风险管理状况，并进行独立汇报；

（3）审慎性原则：风险管理核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（4）有效性原则：风险管理制度具有高度权威性，是所有员工必须严格遵守的行动指南；执行风险管理制度不得有任何例外，任何员工不得拥有超越制度或违反制度的权力；

（5）适时性原则：公司应当根据公司经营战略方针等内部环境和法规、市场环境等外部环境变化及时对风险进行识别和评估，并对其管理政策和措施进行相应的调整；

（6）定量与定性相结合的原则：针对合规风险、操作风险、市场风险、信用风险和流动性风险的不同特点，利用定性和定量的评估方法，建立完备的风险控制指标体系，使风险控制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，内控合规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：负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险；

（2）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

（4）风险管理委员会：拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；

组织实施董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理做出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程；对责任人提出处罚建议，经总经理办公会讨论后执行。

（5）内控合规部：负责公司集中统一的合规管理工作，按照公司规定和督察长的安排履行合规管理职责，建立和完善合规管理及合规风险信息的监控、识别、处置、报告体系，不断提升公司整体合规意识和能力。

（6）风险管理部：通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制；

（7）审计部：通过运用系统化和规范化的方法，审查、评价并改善公司的业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性，以促进公司完善治理、增加价值和实现目标。

（8）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的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、内部控制制度综述

#### （1）风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

#### （2）内控合规管理制度

为保障持续规范发展，公司制定合规管理制度。公司设督察长，负责公司合规管理工作，实施对公司经营管理合规合法性的审查、监督和检查。内控合规部负责公司集中统一的合规管理工作，按照公司规定和督察长的安排履行合规管理职责，建立和完善合规管理及合规风险信息的监控、识别、处置、报告体系，不断提升公司整体合规意识和能力。

### （3）审计管理制度

为规范内部审计工作，公司制定内部审计管理制度。内部审计通过运用系统化和规范化的方法，审查、评价并改善公司的业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性，以促进公司完善治理、增加价值和实现目标。

### （4）内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程，确保会计业务有章可循；按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制；为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度；为了确保基金资产的安全，公司严格规范基金清算交割工作，并在授权范围内，及时准确地完成基金清算；强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度；为了防止会计数据的毁损、散失和泄密，制定了完善的档案保管和财务交接制度。

## 4、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立、健全内控体系，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授权，确保内控合规工作是独立的，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。公司建立、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。公司建立、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。公司建立了风险管理委员会，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，从而以最快速度做出决策；

（5）建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能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，用以提示市场趋势、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。公司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。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人

#### 1、基本情况

名称：国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”或“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：深圳市南山区学府路85号软件产业基地1栋A座22楼

法定代表人：张纳沙

成立时间：1994年6月30日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行、银复[1994]162号

组织形式：股份有限公司

注册资本：961242.9377万元人民币

基金托管资格批文及文号：证监许可[2013]1666号

存续期间：持续经营

联系电话：0755-22941292

联系人：张正男

### （二）基金托管人资产托管业务情况

#### 1、托管业务资质

国信证券于2013年12月31日收到《关于核准国信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可【2013】1666号），获得证券投资基金托管资格。

#### 2、基金托管业务经营情况

截止2021年，国信证券与基金管理公司、证券公司、期货公司、私募基金管理机构及以上公司的子公司均有深度合作。

资产托管业务一直坚持以科技创新引领业务规范发展，公司自主研发流程化估值系统，实现估值流程化、自动化处理，大大提高估值效率：如自主研发“鑫管家”管理人服务平台，实现T+0估值，服务覆盖客户产品运作的各个业务节点，受到客户的广泛认可；自主研发异常监控、估值核对等模块，有效防范、控制风险。

先后荣获多项奖项：包括由《中国基金报》主办的“英华榜”2018与2016年度“最佳私募基金托管券商大奖”；由《21世纪经济报道》主办的2016年度中国



券商/基金“金帆奖”之“最佳主经纪商大奖”；“鑫管家”管理人服务平台2016年入围由深圳市金融办主办的“深圳市金融创新奖”。

### （三）合规管理体系

部门实行前台、中台、后台分离，不同部门、不同岗位间相互牵制，并遵循有序、高效的运行原则，建立科学的决策机制，明确职权、管理程序和业务流程。在开展业务过程中，公司严格遵循利益冲突防范和业务隔离原则，通过基础隔离、系统隔离、敏感信息监控等措施，建立独立的基金托管业务体系和基金服务业务体系，避免利益冲突的产生。

### （四）基金托管人的内部控制制度

#### 1. 内部控制目标

国信证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

#### 2. 内部控制组织结构

公司针对资产托管业务建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持资产托管业务的内部控制制度健全、执行有效。

公司监察稽核总部、风险管理总部、合规管理总部将根据法律法规和公司相关制度，定期或不定期对开展该业务的相关部门进行稽核检查，评估风险控制措施的有效性，对发现的问题，要求相关部门及时整改，并对整改情况进行监督。

### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

国信证券托管部制定投资监督标准与监督流程，依据法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，在授权范围内独立履行对托管资产投资运作的监督职责。

投资监督可以为事中监督和事后监督，主要内容包括：1、对托管资产的投

资范围、投资比例、投资限制进行监督；2、对托管资产的核算估值是否符合相关法律法规和规范性文件、基金合同和托管协议的约定进行监督；3、对托管资产的资金运用、计提和支付各类费用等情况进行监督；4、对托管资产是否存在透支行为、应收款项是否及时足额到账进行监督；5、对托管资产的收益分配是否符合法律法规和托管协议的约定进行监督；6、其他法律法规、基金合同和托管协议约定的监督事项。公司在对托管资产的投资运作监督过程中，发现违反法律、行政法规和其他相关规定，或者违反基金合同和托管协议约定的事项，应当履行通知基金管理人、报告监管部门等程序，并持续跟进基金管理人的后续处理，督促基金管理人依法履行信息披露义务。

## 五、相关服务机构

### （一）基金销售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）天弘基金管理有限公司直销中心

住所：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦 23 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：韩歆毅

电话：（022）83865560

传真：（022）83865564

联系人：司媛

客服电话：95046

##### （2）天弘基金管理有限公司网上直销系统

客服电话：95046

2、本基金的其他销售机构情况详见本基金《基金份额发售公告》或基金管理人网站。

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构，并在基金管理人网站公示。

### （二）登记机构

名称：天弘基金管理有限公司

住所：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦 23 层

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

法定代表人：韩歆毅

电话：（022）83865560

传真：（022）83865564

联系人：薄贺龙

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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

电话：（021）23238888

经办注册会计师：张振波、林佳璐

联系人：林佳璐

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其它法律法规的有关规定募集，已于 2021 年 11 月 1 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2021】3448 号）。

### （二）基金类型与运作方式

基金类型为股票型基金；

本基金的运作方式为契约型开放式。

### （三）基金存续期限

不定期

### （四）基金份额类别

本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：

1、在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。

2、在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

基金管理人可在法律法规和基金合同规定的范围内在不损害基金份额持有人利益的情况下，在履行适当的程序后，增加新的基金份额类别、调整基金份额类别设置、调整基金份额的分类办法及规则或者停止现有基金份额类别的销售等，无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

### （五）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点或其指定的其他方式公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站披露的基金销售机构名录。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购不成立，基金管理人将认购无效的款项退回。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。投资者应在基金合同生效后通过各销售网点或其提供的其他方式查询最终成交确认情况和认购的份额。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

本基金的具体发售方式和发售机构见《基金份额发售公告》。

#### （六）募集期限

本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金的发售期为自 2022 年 4 月 29 日至 2022 年 7 月 28 日止。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长、缩短或调整基金的发售时间，并及时公告。

#### （七）募集规模限制

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，本基金可设置募集规模上限，具体规模限制及规模控制的方案在基金份额发售公告或其他公告中规定。

#### （八）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外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。

#### （九）基金份额发售面值、认购费用及认购份额的计算

1、本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按面值发售。

#### 2、认购费用

募集期投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

本基金分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在认购 A 类基金份额时支付认购费用，认购 C 类基金份额不支付认购费用。

对于 A 类基金份额，本基金对通过本公司直销中心认购的养老金客户实施差

别的优惠认购费率。养老金客户是指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

上述投资群体通过基金管理人的直销中心认购本基金 A 类基金份额的认购费率见下表：

认购金额（M）	费率
M<100万元	0.10%
100万元≤M<200万元	0.06%
200万元≤M<500万元	0.02%
500万元≤M	1000元/笔

其他投资者（包括非养老金客户及未通过基金管理人直销中心认购的养老金客户）认购本基金 A 类基金份额的认购费率见下表：

认购金额（M）	费率
M<100万元	1.0%
100万元≤M<200万元	0.6%
200万元≤M<500万元	0.2%
500万元≤M	1000元/笔

本基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

募集期投资人可以多次认购本基金，A 类基金份额认购费率按每笔认购申请单独计算。

### 3、认购份额的计算

基金认购采用“金额认购、份额确认”的方式。

#### （1）A 类基金份额的认购

A 类基金份额的认购金额包括认购费用和净认购金额。认购份额的计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

（注：对于 500 万（含）以上的适用绝对费用数额的认购，净认购金额=认购金额-固定认购费用）

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

（注：对于 500 万（含）以上的适用绝对费用数额的认购，认购费用=固定认购费用）

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

认购金额、份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者（非养老金客户）投资 10 万元认购本基金 A 类基金份额，该笔认购产生利息 50 元，对应认购费率为 1.0%，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，则其可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (99,009.90 + 50) / 1.00 = 99,059.90 \text{ 份}$$

即：该投资者（非养老金客户）投资 10 万元认购本基金 A 类基金份额，该笔认购产生利息 50 元，对应认购费率为 1.0%，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，可得到 99,059.90 份 A 类基金份额。

例：某投资者（养老金客户）通过本基金管理人的直销中心投资本基金 A 类基金份额 100,000 元，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，认购费率为 0.10%，假定该笔有效认购申请金额募集期产生的利息为 50 元，则可认购 A 类基金份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 0.10\%) = 99,900.10 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,900.10 = 99.90 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (99,900.10 + 50) / 1.00 = 99,950.10 \text{ 份}$$

即：该投资者（养老金客户）通过本基金管理人的直销中心投资 100,000 元认购本基金 A 类基金份额，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，假定该笔有效认购申请金额募集期产生的利息为 50 元，可得到 99,950.10 份 A 类基金份额。

## （2）C 类基金份额的认购



认购份额 = (认购金额 + 认购利息) / 基金份额发售面值

认购金额、份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 10,000 元认购本基金的 C 类基金份额，假定认购期产生的利息为 5.00 元，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，则其可得到的 C 类基金份额为：

认购份额 = (10,000 + 5.00) / 1.00 = 10,005.00 份

即：该投资者投资 10,000 元认购本基金的 C 类基金份额，假定认购期产生的利息为 5.00 元，假设该笔认购最后按照 100%比例全部予以确认，可得到 10,005.00 份 C 类基金份额。

#### （十）投资者对本基金的认购

##### 1、认购时间安排

投资者认购本基金的具体业务办理时间见《基金份额发售公告》。

##### 2、投资者认购本基金应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金应提交的文件和办理的手续见《基金份额发售公告》。

##### 3、认购的方式及确认

投资者在募集期内可多次认购基金份额，认购申请一经受理，不得撤销。

投资者在 T 日规定时间内提交的认购申请，应于 T+2 日通过基金管理人直销系统、基金管理人的客户服务中心或者其他销售机构查询认购申请是否被成功受理。

投资者应于基金合同生效后通过基金管理人直销系统、基金管理人的客户服务中心或者其他销售机构查询认购确认份额。

##### 4、认购的限额

本基金不设最高认购限额，但本招募说明书另有规定的除外。

在本基金募集期内，通过本公司直销系统（含直销中心及网上直销系统）及其他销售机构的首次认购单笔最低金额为 1.00 元（含认购费，下同），追加认购的单笔最低金额 1.00 元。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，但最低认购金额仍不得低于 1.00 元。

如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的

50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

（十一）募集资金及利息的处理

《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

（十二）未来条件许可情况下的基金模式转换

基金管理人有权决定本基金是否转型为基金管理人同时管理的跟踪同一标的的指数的增强交易型开放式指数证券投资基金（ETF）联接基金并相应修改《基金合同》，如决定以 ETF 联接基金模式运作，则届时须按照中国证监会的相关规定履行适当程序并提前公告。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

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

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

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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，本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

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

- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、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则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至下一个工作日划出。

在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

#### （五）申购和赎回的数量限制

- 1、通过本公司直销机构（含直销中心与网上直销系统）及其他销售机构的首

次申购单笔最低金额为人民币 1.00 元（含申购费，下同），追加申购单笔最低金额人民币 1.00 元。收益分配转份额时，不受最低申购金额的限制。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有规定的，以各销售机构的业务规定为准，但最低申购金额仍不得低于人民币 1.00 元。

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔赎回不得少于 1 份。某笔赎回导致基金份额持有人在某一销售机构全部交易账户的份额余额少于 1 份的，基金管理人有权强制该基金份额持有人全部赎回其在该销售机构全部交易账户持有的基金份额。如因红利再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 1 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。各销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理赎回业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### （六）申购和赎回的费用

##### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费用。

对于 A 类基金份额，本基金对通过本公司直销中心申购的养老金客户实施差别的优惠申购费率。养老金客户是指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的

资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

上述投资群体通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额（M）	申购费率
M<100 万元	0.12%
100 万元≤M<200 万元	0.08%
200 万元≤M<500 万元	0.04%
500 万元≤M	1000 元/笔

其他投资者（包括非养老金客户及未通过基金管理人直销中心申购的养老金客户）申购本基金 A 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额（M）	申购费率
M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<200 万元	0.8%
200 万元≤M<500 万元	0.4%
500 万元≤M	1000 元/笔

同一交易日投资人可以多次申购本基金，A 类基金份额的申购费率按每笔申购申请单独计算。

## 2、赎回费用

赎回费率随投资人持有基金份额期限的增加而递减，具体赎回费率结构如下表所示：

	持有期限（T）	赎回费率
A 类	T<7 日	1.50%
	7 日≤T<30 日	0.50%
	30 日≤T	0
C 类	T<7 日	1.50%

	7 日 ≤ T	0
--	---------	---

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人，其赎回费全额计入基金财产。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、申购份额的计算

基金申购采用“金额申购、份额确认”的方式。

##### （1）A 类基金份额的申购

A 类基金份额的申购金额包括申购费和净申购金额，申购份额的计算公式为：

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

（注：对于 500 万（含）以上的适用绝对费用数额的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用）

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

（注：对于 500 万（含）以上的适用绝对费用数额的申购，申购费用 = 固定申购费用）

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者（非养老金客户）投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对



应申购费率为 1.20%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.0160 = 97,258.10 \text{ 份}$$

即：某投资者（非养老金客户）投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 1.20%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，可得到 97,258.10 份 A 类基金份额。

例：某投资者（养老金客户）通过本基金管理人的直销中心投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 0.12%，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.12\%) = 99,880.14 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,880.14 = 119.86 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,880.14 / 1.0400 = 96,038.60 \text{ 份}$$

即：投资者（养老金客户）投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日基金份额净值为 1.0400 元，可得到 96,038.60 份 A 类基金份额。

## （2）C 类基金份额的申购

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额净值}$$

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 10,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的 C 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 10,000.00 / 1.0400 = 9,615.38 \text{ 份}$$

即：该投资者投资 10,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0400 元，可得到 9,615.38 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用。

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额净值}$$

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额 - 赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 90 日，适用赎回费率为 0，假设赎回当日的 A 类基金份额净值是 1.0679 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0679=10,679.00 元

赎回费用=10,679.00×0=0.00 元

净赎回金额=10,679.00-0.00=10,679.00 元

即：该投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 90 日，适用赎回费率为 0，假设赎回当日的 A 类基金份额净值是 1.0679 元，则其可得到的净赎回金额为 10,679.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算

T 日各类基金份额净值=T 日闭市后的该类基金资产净值/T 日该类基金份额的余额数量

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 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 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可

能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、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被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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

7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，具体参照上述（2）方式处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述（1）、（2）方式处理，具体见相关公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

#### （十二）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与

基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （十三）基金的非交易过户

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

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

#### （十四）基金的转托管

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

#### （十五）定期定额投资计划

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

#### （十六）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

#### （十七）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者通过其他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，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。

（十八）基金份额质押

如相关法律法规允许登记机构办理基金份额的质押业务或其他基金业务，登记机构将制定和实施相应的业务规则。

（十九）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、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相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

本基金采用指数增强型投资策略，以中证新能源指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件



面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

#### （1）资产配置策略

本基金为股票指数增强型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例不低于90%，其中投资于标的指数成份股或备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。类别资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。

#### （2）股票投资策略

股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以指数投资为主，量化增强为辅。

##### 1、指数投资策略

本基金的投资组合以成份股在目标指数中的权重为基础，通过控制股票组合中各股票相对其在目标指数中权重的偏离，实现对跟踪误差的控制，进行指数化投资。

##### 2、量化增强策略

本基金使用基金管理人的量化投资团队开发的多因子 $\alpha$ 预测模型、结构化风险模型和交易成本估计模型，通过组合优化的方法构建出股票增强组合，该股票增强组合被约束了预期跟踪误差预算，同时具有较高的交易成本调整后预期超额收益率。本基金将不定期根据最新数据和量化模型优化的结果对股票组合进行调整。

##### 1) 多因子 $\alpha$ 预测模型

该模型是基于中国股票市场长期数据，利用金融理论和数理统计方法，对各因子与股票未来收益率的关系进行深入研究，寻找和开发与未来收益率具有显著关系的因子，包括估值、盈利、成长、波动率、流动性等多个方面的因子。

之后利用特定算法将多个因子整合，根据各股票在这些因子上的暴露值，估

计各股票未来一段时间的  $\alpha$ 。

## 2) 结构化风险模型

该模型是国际上研究和应用较多的风险模型，其逻辑是将个股收益率分解为共有因子的收益率和其特有的收益率，从而将个股风险（收益率的波动）转化为因子风险和其特有风险，将对股票组合的风险估计转化为对因子组合风险的估计和个股特有风险的估计，这样可以减少需要估计的变量个数，使得估计更加准确和稳健。

本基金所用的结构化风险模型也是基于上述逻辑，结合了文献与中国股票市场的具体情况开发而来。通过限制股票组合在各风险因子（如市值、 $\beta$ 、行业等）上相对目标指数的敞口，力争将股票组合的跟踪误差控制在预算范围内。

## 3) 交易成本估计模型

该模型根据各股票的交易活跃程度、买卖价差、交易费用、可能的持有期限等来估计各股票的交易成本，从而在构建股票组合时对各股票的预期超额收益率进行调整，达到优化组合的目的。

## 3、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

### （3）债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

#### 1、信用债券投资策略

由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

##### 1) 市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差

可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

## 2) 单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平。

## 2、证券公司短期公司债券投资策略

本基金投资证券公司短期公司债券，将通过证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 3、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。

## （4）其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与资产支持证券、股指期货、融资及转融通证券出借业务等金融工具的投资。

## 1) 资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析，形成对资产证券的风险和收益进行综合评估，同时依据资产支持证券的定价模型，确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上，本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率，对资产支持证券进行跟踪和测评，从而形成有效的风险评估和控制。

## 2) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 3) 参与融资及转融通证券出借业务策略

为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与融资及转融通证券出借业务，本基金将在分析市场行情和组合风险收益的情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定投资时机、出借证券的范围、期限和比例。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。

## （四）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例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合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；
- (13) 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；
- (14) 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；

（15）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（16）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%；

（17）本基金在任何交易日日终，持有的买入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 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（18）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%；

（19）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%；

（20）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）应当不低于基金资产的 90%；

（21）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

（22）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的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归为流动性受限资产；同时，本基金参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（23）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定从其规定；

（24）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）、（22）情形之外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金

管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、证券发行人合并、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第（22）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律法规或监管部门对上述禁止行为作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的

禁止行为，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应在履行适当程序后向投资者履行信息披露义务。

#### （五）业绩比较基准

本基金投资组合的业绩比较基准为：中证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

中证新能源指数以中证全指为样本空间，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，为市场提供多样化的投资标的。因此，该指数能够较好地反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。

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。

#### （六）风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

#### （七）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。

（八）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 十、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人或基金管理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、期货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。

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

### （三）估值原则

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

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

与上述投资品种相同，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。

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

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

### （四）估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

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

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

### 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供

的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或者两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，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、本基金参与融资及转融通证券出借业务的，按照相关法律法规及行业协会的相关规定进行估值。

8、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。

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

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

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，按照基金管理人根据基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类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，视为该类基金份额净值错误。

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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行：

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息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估值日交易结束后计算当日的基金净值信息并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值信息予以公布。

（九）特殊情况的处理

1、基金管理人、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、由于证券、期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或由于国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（十）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。



## 十二、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

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

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为对应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 十三、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易或结算等费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.1\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.3\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 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、基金标的指数许可使用费（由基金管理人承担）；

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）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （五）基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。

## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》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在2日内在规定媒介公告。

## 十五、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。

### （二）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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”）及《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、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（1）基金招募说明书、《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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、《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。

（2）基金份额发售公告

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

（3）《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媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### （4）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

基金管理人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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （5）基金份额申购、赎回价格

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

#### （6）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经符合《中华人民共和国证券法》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。

#### （7）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；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，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

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

16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、调整基金份额类别；

24、《基金合同》生效后，连续 30、40、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或中国证监会规定的其他事项。

#### （8）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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。

#### （9）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。

#### （10）投资股指期货的信息披露

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

#### （11）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告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。

#### （12）基金参与融资、转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与融资、转融通证券出借业务，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、转融通证券出借业务交易情况，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，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项作详细说明。

#### （13）清算报告

基金合同终止运作的，基金管理人应当依法组织清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》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。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。

#### （14）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （15）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的规定。

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

或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定的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披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

#### （八）暂停或延迟信息披露的情形

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、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 十六、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### （二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过上一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### （四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### （五）实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费、托管费和C类基金份额的销售服务费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### （六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### （七）侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

（八）本部分关于侧袋机制的相关规定，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，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经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。



## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于股票和债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润，并通过对股票市场走势变化等方面的影响，引起基金收益水平的变化。

4、通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

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

6、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

### （二）信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付的风险。另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### （三）流动性风险

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

### 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 2、成份股停牌、摘牌或退市风险管理措施

本基金以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。如指数成份股发生明显负面事件面临停牌、摘牌或退市风险时，可能在一定时间后被剔除指数成份股，或由于尚未达到指数剔除标准，仍存在于指数成份股中。为充分维护基金份额持有人的利益，针对前述风险证券，基金管理人将降低配置比例或全部卖出，或进行合理估值调整，从而可能造成与标的之间的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

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

(3) 当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，具体参照上述（2）方式处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述（1）、（2）方式处理，具体见相关公告。

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

#### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

##### 1) 延期办理巨额赎回申请

上述具体措施详见招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中“（十）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

##### 2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

上述具体措施详见招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中“（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

##### 3) 收取短期赎回费

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

##### 4) 暂停基金估值

当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确

认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

#### 5) 摆动定价

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

#### 6) 实施侧袋机制

投资人具体请参见招募说明书“侧袋机制”部分，详细了解本基金侧袋机制的情形及程序。

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

### 5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值

及变化情况。

#### （四）本基金特有风险

1、本基金为股票指数增强型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于标的指数成份股或备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

2、本基金力争控制将净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。但由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）等原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响，或因某些特殊情况导致流动性不足，或其他原因导致跟踪偏离度、跟踪误差增大而使得跟踪误差控制未达约定目标。

3、本基金采用指数增强量化投资策略进行选股用于增强收益的目的，但不基于量化策略进行频繁交易。在基金投资过程中，多个环节会使用量化选股模型，存在量化模型失效导致基金业绩收益不佳的风险。

4、本基金采用量化增强策略，使用基金管理人的量化投资团队开发的多因子  $\alpha$  预测模型、结构化风险模型和交易成本估计模型，通过组合优化的方法构建出股票增强组合，其主要工作流程包括采集数据、调用模型分析数据、计算目标持仓等几个部分，蕴含了数据风险和模型风险。

本基金建立量化模型的数据来源包括宏观数据、行业信息、上市公司基本财务数据、证券及期货市场交易行情数据、卖方分析师预期及评级数据等多种数据，广泛涵盖各类信息源，相关数据来源于不同数据提供商，且按不同的需求和规范进行预处理。在数据采集、预处理等过程中可能发生数据错误风险，从而对量化模型输出结果造成影响。

本基金基于量化模型进行投资决策，量化投资方法的缺陷在一定程度上会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运用过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型

构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

5、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。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并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 6、《基金合同》自动终止的风险

《基金合同》连续五十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。

故投资者还将面临《基金合同》自动终止的风险。

7、基金管理人有权决定本基金是否转型为基金管理人同时管理的跟踪同一标的指数的增强交易型开放式指数证券投资基金（ETF）联接基金并相应修改《基金合同》，如决定以ETF联接基金模式运作，届时须按照中国证监会的相关规定履行适当程序并提前公告。投资者还有可能面临基金转型的风险。

#### （五）本基金投资股指期货的风险

1、保证金管理风险：股指期货交易采用保证金制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。保证金预留过多会导致资金运用效率过低，减少预期收益。保证金不足将存在被强行平仓的风险，从而导致超出预期的损失。

2、基差风险：基差是指股票现货价格减去同种股指期货价格之差价。理论上，基差具有收敛性，随着到期日接近，现货与期货价格渐趋一致。但实际上套利结束时间与期货合约到期日往往不在同一天，因此在了结套利进行期货合约对

冲时，期货价格尚未收敛至其标的现货价格，存在基差风险。

3、**杠杆风险：**因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

#### （六）资产支持证券投资风险

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。

#### （七）基金参与融资与转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通证券出借业务，可能存在杠杆投资风险、流动性风险以及对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

1、**流动性风险：**本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因，发生无法及时变现并支付赎回款项的风险；

2、**信用风险：**转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券、无法及时支付权益补偿及相关费用的风险；

3、**市场风险：**证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；当已出借证券或一篮子证券中，有部分或单一权重较大的证券，股价出现连续的下跌或连续的上涨，可能造成按市值加权平均计算的出借剩余期限，较大偏离出借之日所预计的平均期限；同时，股价出现连续的下跌或连续的上涨，也会使出借证券的资产占基金资产净值的权重，在出借期间偏离出借之日所预计的权重。

4、**政策风险：**证券出借后如遇相关法律法规要求发生变化，可能影响业务后继运作和收益，甚至产生损失。

#### （八）参与存托凭证的风险

基金资产可投资于存托凭证，会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于创新企业业务持

续能力和盈利能力等经营风险，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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；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；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；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等。

（九）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（十）操作风险

操作风险是指基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

（十一）管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等，都会影响基金的收益水平。

（十二）合规性风险

合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反基金合同有关规定的风险。

（十三）其它风险

1、在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些



工具，基金可能会面临一些特殊的风险：

- 2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；
- 3、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

（十四）声明

- 1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；
- 2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金销售机构公开发售，基金管理人及基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （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、《基金合同》生效后，连续五十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；
- 4、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；
- 5、《基金合同》约定的其他情形；
- 6、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《中华人民共和国证券法》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《中华人民共和国证券法》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，保存期限不少于法定最低期限。

## 十九、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利和义务

#### （一）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，办理基金份额的发售和登记事宜；

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

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用，若委托其他机构办理登记业务的，应对委托的基金登记机构办理基金登记的行为进行监督；

（10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法进行融资及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、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则；

（17）决定本基金证券交易模式的转换（包括由券商结算模式转换为托管人结算模式，或由托管人结算模式转换为券商结算模式）。若本基金采用“券商结算模式”的，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪商，并签订证券经纪服务协议；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法定最低期限；

（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条件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，按规定向基金托管人提供基金份额

持有人名册资料；

（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。

（二）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和证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

（4）除依据《基金法》、《基金合同》、《托管协议》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》及《托管协议》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》、《托管协议》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，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法定最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》、《托管协议》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。

(三) 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。

同一类别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、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

- 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
  - (1) 终止《基金合同》，但本基金合同另有约定的除外；
  - (2) 更换基金管理人；
  - (3) 更换基金托管人；
  - (4) 转换基金运作方式（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
  - (6) 变更基金类别（法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
  - (7) 本基金与其他基金的合并；
  - (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
  - (9) 变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《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、调低赎回费率或销售服务费率、或者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、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

（6）基金推出新业务或服务；

（7）转换本基金证券交易模式；

（8）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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，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50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

#### （2）通讯开会

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

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异



行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## 2、通讯开会

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

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。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）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额

持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、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；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）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，经与基金托管人协商一致，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的

基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （二）收益分配方案

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

#### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

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

### 四、基金资产净值的计算方法和公告方式

#### （一）基金财产净值的计算方法

基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

#### （二）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

基金管理人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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

### 五、基金合同变更和终止事由、程序以及基金财产清算方式

#### （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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（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、《基金合同》生效后，连续五十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；

4、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；

5、《基金合同》约定的其他情形；

6、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《中华人民共和国证券法》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《中华人民共和国证券法》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，保存期限不少于法定最低期限。

六、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履

行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### 七、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十、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（或简称“管理人”）

名称：天弘基金管理有限公司

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：国信证券股份有限公司

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、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相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

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。

#### 2、对基金投融资比例进行监督：

（1）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例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合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包

括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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

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

（12）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（13）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；

（14）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；

（15）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（16）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%；

（17）本基金在任何交易日日终，持有的买入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 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（18）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%；

（19）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%；

（20）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）应当不低于基金资产的 90%；

（21）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

（22）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的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归为流动性受限资产；同时，本基金参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

（23）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定从其规定；

（24）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）、（22）情形之外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金

管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、证券发行人合并、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第（22）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告。

### 3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

4、法律法规或监管部门对基金合同所述禁止行为作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整

涉及本基金的禁止行为，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应在履行适当程序后向投资者履行信息披露义务。

（二）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 risk 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）本基金参与交易所债券质押式融资回购交易前，需事先与基金托管人协商一致，并签署托管人结算模式债券质押式回购委托协议等基金托管人要求的协议文本后方可开展。

（四）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、各类基金份额的基金份额净值计算、各类基金份额的基金份额累计净值计算、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。

（五）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。

（六）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，并有权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，并有权依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（七）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。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期限内，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、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、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

### 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、证券账户等投资所需账户。

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

5、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、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《中华人民共和国证券法》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）中国注册会计师签字方为有效。

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

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，基金托管人应予以必要的协助和配合。

## （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托管账户；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。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。存款协议须约定“为确保资金安全，基金管理人承诺存款证实书不得被质押，不得用于背书和转让。存款行不得接收基金管理人或基金托管人任何一方单方面

提出的对存款进行更名、转让、挂失、质押、撤销、变更印鉴及汇款账户信息等可能导致财产转移的操作申请。将托管人为本产品开立的托管账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。”

（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。

7、基金管理人在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下，可以根据本基金实际情况，决定本基金的证券交易结算模式，无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金采用券商结算模式，则相关账户的开设和管理按照以下规定执行：

（1）基金管理人为基金财产在证券经纪商开立证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与基金托管人开立的基金托管账户建立第三方存管关系。证券经纪商根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经纪商开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。

(2) 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开设的证券交易资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经纪商负责。

(3) 券商结算模式下不涉及的相关账户（如结算备付金账户等）无需开立。

(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。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。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。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管，保管期限不少于法定最低期限。

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、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是按

照每个估值日闭市后，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、基金管理人应每估值日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的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估值日交易结束后计算得出当日各类基金份额的基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生估值错误时，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；当计价错误达到该类基金份额净值的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；当计价错误达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，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、由于证券、期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或由于国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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；《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。季度报告应在季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并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；中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并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；年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金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。

## 五、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。

## 六、争议解决方式

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

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。如经友好协商未经解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## 七、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。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### （一）对账单服务

1、基金份额、持有人可登录本公司网站(www.thfund.com.cn)查阅对账单。

2、基金份额持有人可通过拨打我司客服电话（95046）订制电子对账单（短信账单或邮件账单）或其他类型的对账单。

由于投资者提供的手机号码、电子邮箱不详或因通讯故障、延误等原因，造成对账单无法按时准确送达，请及时到原基金销售网点或致电本公司客服中心办理相关信息变更。如需补发对账单，敬请拨打客服热线。

### （二）基金间转换服务

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资者办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。

### （三）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人可为基金投资者提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短信（因相关方技术系统原因，小灵通用户暂不享有短信服务，待技术系统开发运行成功后，基金管理人将及时向小灵通用户提供上述服务）、EMAIL 等方式为基金投资者发送所订制的信息，内容包括：交易确认信息、公告信息、投资理财刊物邮件等。

### （四）资讯服务

#### 1、信息查询密码

基金管理人为场外基金份额持有人预设基金查询密码，预设的基金查询密码为投资者开户证件号码的后 6 位数字，不足 6 位数字的，前面加“0”补足。基金查询密码用于投资者查询基金账户下的账户和交易信息。投资者请在知晓基金账号后，及时拨打本公司客户服务中心电话或登录本公司网站修改基金查询密码。

#### 2、客户服务电话

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打本公司客户服务中心电话。

客户服务电话：95046

传真：（022）83865564

### 3、互联网站

公司网址：www.thfund.com.cn

电子信箱：service@thfund.com.cn

#### （五）客户投诉处理

投资者可以拨打销售机构和本公司客户服务中心电话投诉直销机构或其他销售机构的人员和服务。

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

## 二十二、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 二十三、标的指数的编制方法及指数信息查阅方式

### 一、标的指数编制方法

中证新能源指数以中证全指为样本空间，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，为市场提供多样化的投资标的。

#### （一）指数名称和代码

指数名称：中证新能源指数

指数简称：中证新能

英文名称：CSI New Energy Index

英文简称：CSI New Energy

指数代码：399808

#### （二）指数基日和基点

该指数以 2011 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

#### （三）样本选取方法

##### 1、样本空间

中证全指指数样本股

##### 2、选样方法

（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。

#### （四）指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum$  (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%。

#### （五）指数样本和权重调整

##### 1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

##### 2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照中证指数有限公司计算与维护细则处理。

#### 二、标的指数信息查询途径

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

## 二十四、备查文件

（一）中国证监会准予天弘中证新能源指数增强型证券投资基金募集注册的文件

（二）关于申请募集注册天弘中证新能源指数增强型证券投资基金之法律意见书

（三）基金管理人业务资格批件、营业执照

（四）基金托管人业务资格批件、营业执照

（五）《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金基金合同》

（六）《天弘中证新能源指数增强型证券投资基金托管协议》

（七）中国证监会规定的其他文件

以上第（四）项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所、营业场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

天弘基金管理有限公司

二〇二二年七月十四日