

# 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金更新招募说明书

(2022年09月17日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2012 年 11 月 27 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012]1588 号）的核准公开发售。本基金基金合同于 2013 年 2 月 6 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、基金组合回报与标的指数回报偏离的风险、本基金的特有风险等。本基金被动跟踪标的指数“中证 500 指数”，因此，本基金的业绩表现与中证 500 指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。投资者投资于本基金可能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。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，若本基金投资存托凭证的，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

本基金标的指数为中证 500 指数。

（1）指数样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、\*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

科创板证券：上市时间超过一年。

创业板证券：上市时间超过三年。

其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

（2）选样方法①在样本空间中剔除沪深 300 指数样本以及过去一年日均总市值排名前 300 的证券；

②对样本空间内剩余证券按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

③将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前 500 的证券作为指数样本。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所，本基金的申购、赎回流程与组合证券仅在深圳或上海交易所上市的 ETF 产品有所差异。本基金现采用“实物申购赎回”和场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式通过深圳证券交易所办理。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书更新了“基金份额的交易”章节中基金的场内简称相关内容，并对基金管理人等信息一并更新。

## 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	11
四、基金托管人.....	22
五、相关服务机构.....	24
六、基金的募集.....	32
七、基金合同的生效.....	38
八、基金份额折算与变更登记.....	39
九、基金份额的交易.....	40
十、基金份额的申购、赎回.....	42
十一、基金的非交易过户等其他业务.....	122
十二、基金的投资.....	123
十三、基金的业绩.....	136
十四、基金的融资融券及转融通.....	138
十五、基金的财产.....	139
十六、基金资产估值.....	140
十七、基金收益与分配.....	145
十八、基金的费用与税收.....	146
十九、基金的会计与审计.....	149
二十、基金的信息披露.....	150
二十一、风险揭示.....	155
二十二、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	160
二十三、基金合同内容摘要.....	162
二十四、基金托管协议的内容摘要.....	175
二十五、对基金份额持有人服务.....	190
二十六、其他应披露事项.....	191
二十七、招募说明书存放及查阅方式.....	192
二十八、备查文件.....	193

## 一、绪言

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

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。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本基金合同的当事人，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

本《招募说明书》中除非文意另有所指,下列词语有如下含义:

基金或本基金	指嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金;
基金合同	指《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充;
招募说明书或本招募说明书	指《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新;
基金份额发售公告	指《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》;
托管协议	指《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
中国	中华人民共和国(仅为本招募说明书目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
中国证监会	指中国证券监督管理委员会;
银行业监督管理机构	指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布,于 2004 年 7 月 1 日起实施并于 2014 年 7 月 7 日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订
《信息披露办法》	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《流动性风险管理规定》	指中国证监会 2017 年年 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
《登记结算业务实施细则》	指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订；
交易型开放式指数证券投资基金	指《登记结算业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”；
ETF 联接基金	指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金；
元	指人民币元；
基金管理人	指嘉实基金管理有限公司；
基金托管人	指中国建设银行股份有限公司；
登记结算业务	指《登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务；
登记结算机构	指办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司；
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
机构投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者	指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
人民币合格境外机构投资者	指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
投资人	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
基金份额持有人大会	指按照基金合同第十部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或

	其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
基金合同生效日	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日	指深圳证券交易所及上海证券交易所的正常交易日；
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；
申购	指基金合同生效后的存续期间，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；
赎回	指基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将其持有的基金份额兑换为基金合同约定的对价资产的行为；
申购赎回清单	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价	指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
赎回对价	指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
标的指数	指中证指数有限公司编制并发布的中证 500 指数及其未来可能发生的变更；
组合证券	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
完全复制法	指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的；
最小申购赎回单位	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基

	金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍；
现金替代	指申购或赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
现金替代退补款	指投资者支付的现金替代与基金购入被替代成份证券的成本及相关费用的差额。若现金替代大于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则本基金需向投资者退还差额，若现金替代小于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则投资者需向本基金补缴差额；
现金差额	指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
预估现金差额	由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结；
基金份额参考净值	指基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由深圳证券交易所交易所在交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV；
指令	指基金管理人在管理基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商（代办证券公司）；
销售机构	指直销机构和代销机构；
基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点；
发售代理机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；
申购赎回代理券商	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公



	司；
指定媒介	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
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；
T 日	指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日；
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日，n 为自然数）；
收益评价日	指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日；
基金净值增长率	指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
标的指数同期增长率	指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；
基金资产总值	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项及其他资产的价值总和；
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数；
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；
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
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律法规、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；

不可抗力	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件。
基金产品资料概要	指《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层
法定代表人	经雷
成立日期	1999 年 3 月 25 日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司 40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司 30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务等资格。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

赵学军先生，党委书记，董事长，北京大学国民经济专业毕业，博士。2000 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，2000 年 10 月至 2017 年 11 月任公司党委书记、董事、总经理，2017 年 11 月至今任公司党委书记、董事长。在加入嘉实基金之前，曾任大成基金管理有限公司副总经理，并曾在期货公司、商品交易所、进出口公司担任主要管理职位。

安国勇先生，联席董事长，博士研究生，中共党员。曾任职于招商银行北京分行，中国民航总局金飞民航经济发展中心总经理助理兼证券业务部经理，北京城市铁路股份有限公司

总经理，北京市轨道交通建设管理有限公司副总经理，北京市保障性住房建设投资中心副总经理，中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁。现任中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。

尤彦媚女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任职于吉林省产品质量监督检验所，曾任吉林省信托投资有限责任公司总经理助理。2005 年 5 月起任职于中诚信托有限责任公司，现任中诚信托有限责任公司业务总监兼财富管理中心总经理。

Mark H. Cullen 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD，德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD，德意志银行（伦敦）首席运营官，德意志银行全球审计主管。现任 DWS Management GmbH 执行董事、全球首席运营官。

Holger Wilhelm Naumann 先生，董事，德国籍。曾任 DWS Investment GmbH 子公司管理、业务发展、业务区域控制欧洲负责人，DWS 资产管理（德国）管委会成员、COO，DWS 资产管理（欧洲）COO，RREEF Management GmbH RREEF 德国负责人，DWS 全球 COO，德意志资产管理全球 COO，DWS 管理委员会成员、亚太区负责人，现任 DWS Investments Hong Kong Limited 董事会主席、亚太区负责人。

韩家乐先生，董事，清华大学经济管理学院工业企业管理专业，硕士研究生。1990 年 2 月至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限公司总经理。1994 年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今任立信投资有限责任公司董事长；2004 年至今任陕西秦明电子（集团）有限公司董事长；2013 年至今任麦克传感器股份有限公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国 Fordham University 经济学博士。并购公会创始会长，金融博物馆理事长。曾长期担任中欧国际工商学院和长江商学院的客座教授。2004 年主持创建了全联并购公会；2005 年担任经济合作与发展组织（OECD）投资委员会专家委员，2007 年起担任上海证券交易所公司治理专家委员会成员；2010 年创建了系列金融博物馆，在北京、上海、天津、宁波、苏州、成都、沈阳、郑州和井冈山有十处不同主题的分馆，也参与香港金融博物馆的创建。

汤欣先生，独立董事，法学博士，清华大学法学院教授、博士生导师，清华大学商法研究中心副主任、清华大学全球私募股权研究院副院长，《清华法学》副主编。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员、深圳证券交易所法律咨询委员会委员、中国上市公

司协会独立董事委员会主任委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员。

王瑞华先生，独立董事，博士，注册会计师（非执业）。现任中央财经大学粤港澳大湾区研究院执行院长，会计学教授、博士生导师。曾任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任，担任全国工商管理专业学位研究生教育指导委员会委员、中国管理现代化研究会理事、中国上市公司协会独立董事委员会委员。

经雷先生，董事，总经理，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1994 年 6 月至 2008 年 5 月任 AIG Global Investment Corp 高级投资分析师、副总裁；2008 年 5 月至 2013 年 9 月任友邦中国区资产管理中心首席投资总监、副总裁。2013 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，2013 年 10 月至 2018 年 3 月任公司首席投资官（固收/机构），2018 年 3 月至今任公司总经理。

袁管华先生，监事长，博士研究生，中共党员。曾任中国人民银行外资金机构管理司副处长、银行监管一司处长；中国银监会财务会计部处长，江西监管局副局长、党委委员；中国银监会财务会计部正局级巡视员；中诚信托有限责任公司第四届监事会副监事长。现任中诚信托有限责任公司副监事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信投资有限公司财务总监。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000 年 7 月至 2004 年 8 月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004 年 9 月至 2006 年 1 月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006 年 2 月至 2007 年 10 月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007 年 10 月至 2010 年 12 月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监、基金运营部总监，现任财务部总监。

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006 年 9 月至 2010 年 7 月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010 年 7 月至 2011 年 1 月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011 年 1 月至 2013 年 11 月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管，2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，现任合规管理部稽核组执行总监。

杨竞霜先生，副总经理、首席信息官，博士研究生，美国籍。曾任日本恒星股份有限公司软件工程师，高盛集团核心策略部副总裁，瑞银集团信息技术部董事总经理，瑞信集团信息技术部董事总经理，北京大数据研究院常务副院长。2020 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司副总经理、首席信息官。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

## 2、首席风险官及投资总监

张敏女士，首席风险官，博士研究生。曾任德邦证券有限责任公司投资经理助理。2010 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任风险管理部副总监、风险管理部总监。

归凯先生，成长风格投资总监，硕士研究生。曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监。

胡涛先生，平衡风格投资总监，MBA。曾任北京证券投资银行部经理，中金公司股票研究经理，长盛基金研究员，友邦华泰基金基金经理助理，泰达宏利基金专户投资部副总经理、研究部研究主管、基金经理等职务。2014 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任 GARP 策略组投资总监。

洪流先生，平衡风格投资总监，硕士研究生。曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。

张金涛先生，价值风格投资总监，硕士研究生。曾任中金公司研究部能源组组长，润晖投资高级副总裁负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任海外研究组组长、策略组投资总监。

胡永青先生，投资总监（固收+），硕士研究生。曾任天安保险固定收益组合经理，信诚基金投资经理，国泰基金固定收益部总监助理、基金经理。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。

赵国英女士，投资总监（纯债），硕士研究生。曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司。

## 3、基金经理

### （1）现任基金经理

李直先生，硕士研究生，8 年证券从业经历，具有基金从业资格。中国国籍。2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。2019 年 3 月 30 日至 2021 年 9 月 4 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 3 月 30 日至 2021 年 9 月 4 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 26 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 9 月 28 日至 2022 年 1 月 25 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 11 月 1 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实中证新兴科技 100 策略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 5 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实中证先进制造 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2020 年 4 月 24 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 1 月 25 日至 2022 年 4 月 21 日任嘉实中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 4 月 6 日至 2022 年 4 月 21 日任嘉实中证医药健康 100 策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 12 月 26 日至今任嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 12 月 26 日至今任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 3 月 30 日至今任嘉实中证大农业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 6 月 10 日至今任嘉实恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理、2021 年 7 月 2 日至今任嘉实黄金证券投资基金(LOF)基金经理、2021 年 8 月 18 日至今任嘉实中证新能源汽车指数证券投资基金基金经理、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证科创创业 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、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2021 年 9 月 24 日至今任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金(LOF)基金经理、2022 年 1 月 19 日至今任嘉实中证信息安全主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022 年 1 月 20 日至今任嘉实中证医疗指数型发起式证券投资基金基金经理、2022 年 1 月 25 日至今任嘉实中证光伏产业指数型发起式证券投资基金基金经理、2022 年 3 月 23 日至今任嘉实上海金交易型开放式证券投资基金基金经理，

何如女士，硕士研究生，16 年证券从业经历，具有基金从业资格。加拿大国籍。曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监、基金经理。2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2014 年 5 月 9 日至 2016 年 3 月 24 日任中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 13 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2014 年 6 月 20 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2015 年 8 月 6 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2017 年 12 月 26 日任深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2019 年 9 月 28 日任嘉实黄金证券投资基金 (LOF) 基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、2016 年 1 月 5 日至 2022 年 1 月 25 日任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF) 基金经理、2017 年 6 月 29 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2017 年 7 月 3 日至 2019 年 3 月 30 日任嘉实富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2017 年 7 月 14 日至 2019 年 4 月 2 日任嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 5 月 23 日至 2021 年 9 月 24 日任嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 8 月 8 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2019 年 12 月 9 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实沪深 300 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2020 年 3 月 16 日至 2021 年 9 月 9 日任嘉实中证 500 成长估值交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2016 年 1 月 5 日至今任嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

#### (2) 历任基金经理

杨宇先生，管理时间为 2013 年 2 月 6 日至 2016 年 1 月 5 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 1 月 5 日至 2021 年 9 月 24 日。

#### 4、Smart Beta 及指数投资决策委员会



Smart-Beta 及指数投资决策委员会的成员包括：Smart-Beta 和指数投资板块负责人张峰先生，公司总经理经雷先生，指数投资部负责人刘珈吟女士，指数基金经理何如女士，增强风格投资总监刘斌先生。

5、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、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、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、有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

### （四）基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反法律法规行为的发生。

3、本基金管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将基金财产用于下列投资或活动：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资或活动；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

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

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

(1) 越权或违规经营，违反基金合同或托管协议；

(2) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

(3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；

(4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(5) 玩忽职守、滥用职权；

(6) 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；

(7) 除按依法进行基金资产管理外，直接或间接进行其他股票投资；

(8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(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；

(4) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人内部控制制度

##### 1. 内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、合规管理和风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

##### 2. 内部控制的原则

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

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

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

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

### 3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）Smart Beta 及指数投资决策委员会由公司总经理、部门负责人及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长以及相关部门负责人组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。合规管理部门具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监控检查工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

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

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

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

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

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

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

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

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12)公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性进行监控核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李莉

联系电话：(021)6063 7111

#### 2、主要人员情况

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

#### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2021 年一季度末，中国建设银行已托管 1097 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并在 2017、2019 及 2020 年分别荣获《亚

洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”以及“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

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

### 3、内部控制制度及措施

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

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

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

### 2、监督流程

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

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代办券商

##### （1）中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市东城区朝内大街 188 号		
注册地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	http://www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

##### （2）国信证券股份有限公司

办公地址	广东省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		
注册地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	李颖
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

##### （3）招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号		
法定代表人	霍达	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	4008881111、95565

##### （4）广发证券股份有限公司

办公地址	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦		
注册地址	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室		
法定代表人	孙树明	联系人	陈姗姗



电话	(020) 66338888	传真	(020) 87555305
网址	http://www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

## (5) 中信证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
注册地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座		
法定代表人	张佑君	联系人	郑慧
电话	010-60838888		
网址	http://www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

## (6) 中国银河证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座		
办公地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层		
法定代表人	陈亮	联系人	辛国政
电话	010-83574507	传真	010-83574807
网址	http://www.chinastock.com.cn	客服电话	4008-888-888

## (7) 申万宏源证券有限公司

住所	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号		
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层		
法定代表人	李梅	联系人	陈宇
电话	021-33388214	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	95523 或 4008895523

## (8) 兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路 268 号		
办公地址	福建省福州市湖东路 268 号		
注册地址	福建省福州市湖东路 268 号		
法定代表人	杨华辉	联系人	乔琳雪

电话	021-38565547		
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

## (9) 安信证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
注册地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
法定代表人	黄炎勋	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355
网址	http://www.essence.com.cn	客服电话	4008001001

## (10) 华泰证券股份有限公司

办公地址	江苏省南京市江东中路 228 号		
注册地址	江苏省南京市江东中路 228 号		
法定代表人	周易	联系人	庞晓芸
电话	0755-82492193	传真	0755-82492962 (深圳)
网址	http://www.htsc.com.cn	客服电话	95597

## (11) 中信证券(山东)有限责任公司

住所	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
办公地址	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层		
注册地址	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
法定代表人	姜晓林	联系人	焦刚
电话	(0531) 89606166	传真	(0532) 85022605
网址	http://sd.citics.com/	客服电话	95548

## (12) 方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717		
注册地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
电话	(010) 59355997	传真	(010) 56437013

网址	http://www.founde rsc.com	客服电话	95571
----	------------------------------	------	-------

## (13) 长城证券股份有限公司

住所	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
办公地址	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
注册地址	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
法定代表人	曹宏	联系人	金夏
电话	(021)62821733	传真	(0755)83515567
网址	http://www.cgws.c om	客服电话	4006666888、 (0755)33680000

## (14) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
注册地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	周健男	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	http://www.ebscn. com	客服电话	4008888788、 10108998

## (15) 中信证券华南股份有限公司

住所	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼		
办公地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层		
注册地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层		
法定代表人	胡伏云	联系人	梁微
电话	020-88836999	传真	020-88836984
网址	http://www.gzs.co m.cn	客服电话	95396

## (16) 浙商证券股份有限公司

住所	浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼		
办公地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
注册地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
法定代表人	吴承根	联系人	许嘉行
电话	(0571) 87901912	传真	(0571) 87901913
网址	http://www.stocke .com.cn	客服电话	(0571) 967777

## (17) 申万宏源西部证券有限公司

办公地址	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
注册地址	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室		
法定代表人	李琦	联系人	王怀春
电话	0991-2307105	传真	0991-2301927
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

## (18) 中泰证券股份有限公司

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
办公地址	济南市市中区经七路 86 号		
注册地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	许曼华
电话	021-20315290		
网址	http://www.zts.co m.cn/	客服电话	95538

## (19) 中国国际金融股份有限公司

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
法定代表人	丁学东	联系人	杨涵宇
电话	(010)65051166	传真	(010)85679203
网址	http://www.cicc.c om.cn	客服电话	400 910 1166

## (20) 华创证券有限责任公司

办公地址	贵州省贵阳市中华北路 216 号		
注册地址	贵州省贵阳市中华北路 216 号		
法定代表人	陶永泽		
电话	0851-33223390		
网址	http://www.hczq.c om/	客服电话	4008666689

## (21) 海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路 98 号		
----	-------------	--	--

办公地址	上海市广东路 689 号		
注册地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	周杰	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021)23219000	传真	(021)23219100
网址	http://www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

## (22) 东北证券股份有限公司

办公地址	长春市生态大街 6666 号		
注册地址	吉林省长春市生态大街 6666 号		
法定代表人	李福春	联系人	安岩岩
电话	(0431)85096517	传真	(0431)85096795
网址	http://www.nesc.cn	客服电话	95360

## (23) 国联证券股份有限公司

办公地址	无锡市金融一街 8 号		
注册地址	江苏省无锡市金融一街 8 号		
法定代表人	姚志勇	联系人	祁昊
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	http://www.glsc.com.cn	客服电话	95570

## (24) 第一创业证券股份有限公司

住所	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼		
办公地址	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 9、16-20 楼		
注册地址	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼		
法定代表人	刘学民	联系人	毛诗莉
电话	(0755)23838750	传真	(0755)25838701
网址	http://www.firstcapital.com.cn	客服电话	95358

## (25) 新时代证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
注册地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
法定代表人	叶顺德	联系人	田芳芳
电话	(010)83561146		

网址	http://www.xsdzq.cn	客服电话	95399
----	---------------------	------	-------

## (26) 国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路 88		
办公地址	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼		
注册地址	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼		
法定代表人	徐丽峰	联系人	占文驰
电话	(0791)86283372	传真	(0791)86281305
网址	www.gszq.com	客服电话	4008222111

## (27) 宏信证券有限责任公司

办公地址	成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼		
注册地址	成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	http://www.hx818.com	客服电话	4008366366

## 2、二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

## (二) 登记结算机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号		
法定代表人	于文强		
联系人	赵亦清		
电话	(010) 50938782		
传真	(010) 50938991		

## (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、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	陈颖华
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	黎明、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	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室		
办公地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	周祎
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的相关规定、并经中国证券监督管理委员会 2012 年 11 月 27 日《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2012] 1588 号）核准募集。

### （一）基金运作方式和类型

- 1、基金的类别：股票型
- 2、基金的运作方式：交易型开放式

### （二）基金存续期

不定期

### （三）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象

- 1、募集期限：2013 年 1 月 7 日至 2013 年 1 月 31 日。
- 2、募集方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。
- 3、募集场所：投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。
- 4、募集对象：符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者及人民币合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （四）募集规模上限

本基金不设定发售规模上限。

### （五）基金的认购份额面值、认购价格

本基金每份基金份额初始面值为 1.00 元，按初始面值发售。



## （六）认购费用

认购费用由投资者承担，不高于 1%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
50 万份以下	1.0%
50 万份以上(含 50 万份)－100 万份以下	0.5%
100 万份以上(含 100 万份)	每笔 1000 元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。销售机构办理网上现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

## （七）网上现金认购

1、认购时间：2013 年 1 月 7 日至 2013 年 1 月 31 日。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

## （八）网下现金认购

1、认购时间：2013 年 1 月 7 日至 2013 年 1 月 31 日。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购价格 × 认购份额 × 认购费率

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

3、T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于 T+1 日进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

#### (九)网下股票认购

1、认购时间：2013 年 1 月 28 日至 2013 年 1 月 31 日。

2、认购限额：

以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证 500 指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为 1000 股，超过 1000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到基金销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销，发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。投资者的认购股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

4、特别提示：投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

5、特殊情形

(1) 已公告的将被调出中证 500 指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少 3 日公告限制认购规模的个股名单。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

6、清算交收：T 日日终(T 日为本基金发售期最后一日)，发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结

上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金管理人作为投资者计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海和深圳的股票分别过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

#### 7、认购份额的计算公式：

投资者的认购份额 =  $\sum$  (第  $i$  只股票在  $T$  日的均价  $\times$  有效认购数量) / 1.00

其中，

(1)  $i$  代表投资者提交认购申请的第  $i$  只股票，如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则  $i=1, i \leq 500$ 。

(2) “第  $i$  只股票在  $T$  日的均价”由基金管理人根据深圳证券交易所及上海证券交易所的  $T$  日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在  $T$  日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在  $T$  日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在  $T$  日的均价进行调整：

①除息：调整后价格 =  $T$  日均价 - 每股现金股利或股息

②送股：调整后价格 =  $T$  日均价 / (1 + 每股送股比例)

③配股：调整后价格 = (  $T$  日均价 + 配股价  $\times$  配股比例 ) / (1 + 每股配股比例)

④送股且配股：调整后价格 = (  $T$  日均价 + 配股价  $\times$  配股比例 ) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

⑤除息且送股：调整后价格 = (  $T$  日均价 - 每股现金股利或股息 ) / (1 + 每股送股比例)

⑥除息且配股：调整后价格 = (  $T$  日均价 + 配股价  $\times$  配股比例 - 每股现金股利或股息 ) / (1 + 每股配股比例)

⑦除息、送股且配股：调整后价格 = (  $T$  日均价 + 配股价  $\times$  配股比例 - 每股现金股利或股息 ) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构完成清算交收的股票股数。其中，

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

公式：

$$q^{\max} = (\text{Cash} + \sum_{j=1}^n p_j q_j) \times 105\% \times w / p$$

$q^{\max}$ ：限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量；

$\text{Cash}$ ：网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；

$p_j q_j$ ：除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股当日均价和认购申报数量乘积；

$w$ ：该股按均价计算的其在网下股票认购日中证500指数中的权重，（认购期间如有中证500指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及中证500指数编制规则计算调整后的中证500指数构成权重，并以其作为计算依据）；

$p$ ：该股在网下股票认购日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的，则按比例分配确认。

②若某一股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法冻结或执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

#### (十) 募集资金利息与募集股票权益的处理方式

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，募集资金利息在基金募集期结束时归入投资者认购金额中，折合成基金份额，归投资者所有。

基金网下股票认购所募集的股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

#### (十一) 募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。基金网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。基金募集期间的信息披露

费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同自 2013 年 2 月 6 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金合同生效后的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或证券监管部门另有规定的，从其规定办理。

## 八、基金份额折算与变更登记

### （一）基金份额折算的时间

2013 年 3 月 5 日。

### （二）基金份额折算的原则

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

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### （三）基金份额折算的方法

#### 1、折算对象

基金份额折算日在本基金登记结算机构登记在册的本基金基金份额。

其中：本基金登记结算机构为中国证券登记结算有限公司

#### 2、折算方式

本次基金份额折算后，本基金基金份额净值与基金份额折算日中证 500 指数收盘值的千分之一基本一致。

基金份额折算比例=  $(X/Y) \div (I/1000)$ ，以四舍五入的方法保留至小数点后 8 位。上述公式中，X 为基金份额折算日收市后，经本基金管理人计算并经托管人复核的该日本基金基金资产净值；Y 为基金份额折算日在本基金登记结算机构登记在册的本基金基金份额总额；I 为基金份额折算日中证 500 指数收盘值。

折算后的基金份额采用保留至整数位，小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

基金份额折算后，基金资产净值（包括已实现收益、未实现收益和实收基金的金额）没有变化，本基金未来的分红能力也不受影响，仅基金份额总额与持有人持有的基金份额数相应调整，对基金份额持有人所代表的表决权和收益分配权等权益无实质性影响。

#### 3、折算结果

中国证券登记结算有限责任公司按折算比例 0.28038605 对 2013 年 3 月 5 日（权益登记日）登记在册的本基金的基金份额实施折算，并于 2013 年 3 月 6 日进行了变更登记，折算后的基金份额保留到整数位，小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

## 九、基金份额的交易

### （一）基金上市

本基金于 2013 年 3 月 15 日在深圳证券交易所上市交易，基金场内简称：中证 500ETF，基金代码：159922。

### （二）基金份额的交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易、暂停或终止上市交易，应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其他有关规定。

### （三）暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的上市条件；
- 2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

当暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在指定媒介发布基金恢复上市公告。

### （四）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 日内发布基金终止上市公告。

若因上述 1、4 项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式指数证券投资基金变更为以中证 500 指数为标的指数的非上市的开放式指数基金。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，确定是否选取其他合适的指数作为标的指数。

### （五）基金份额参考净值的计算与公告



基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司在相关证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV）并由深圳证券交易所交易所在交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金差额) / 最小申购赎回单位对应的基金份额。

2、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

## 十、基金份额的申购、赎回

本基金现采用“实物申购赎回”和场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式两种方式。其中，“实物申购赎回”通过中国证券登记结算有限责任公司办理，场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式通过深圳证券交易所办理。

### 一、实物申购赎回

#### （一）申购和赎回场所

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

投资者可以通过基金管理人直销中心办理基金申购、赎回业务。

#### （二）申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

基金投资者办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所及上海证券交易所的交易日，具体办理时间为相关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，若出现相关证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，并应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；若证券交易场所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，基金管理人在次日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

本基金自 2013 年 3 月 15 日起办理申购与赎回业务。

#### （三）申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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

目前，本基金最小申购、赎回单位为 40 万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定指定媒介公告。

#### （四）申购和赎回的原则

- 1、申购、赎回应遵守《登记结算业务实施细则》及其他相关规定。
- 2、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 3、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 4、申购、赎回申请提交后不得撤销。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （五）申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回申请的提出

（1）投资者办理申购或赎回业务，应同时持有并使用深圳 A 股账户和上海 A 股账户，并保证这两个账户的证件号码和名称属于同一投资者所有；

（2）投资者的相关证券和基金份额应当托管在申购赎回代理券商，且投资者深圳托管的托管单元与上海指定交易的交易单元为同一申购赎回代理券商；

（3）投资者通过该申购赎回代理券商申报申购、赎回业务。

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

投资者在申购本基金时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在 T+1 日进行确认。

对于投资者提交的申购申请，申购赎回代理券商根据投资者提交的申购申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资者账户内的组合证券、现金替代款和预估现金差额，登记结算机构在完成 T 日全部登记结算业务处理后，对申请申购的组合证券予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1 日，基金管理人根据冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，则申购申请失败。

对于投资者提交的赎回申请，申购赎回代理券商根据投资者提交的赎回申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资者账户内的基金份额、预估现金差额，登记结算机构在完成 T 日全部登记结算业务处理后，对申请赎回的基金份额予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1 日，基金管理人根据冻结情况对投资者的赎回申请予以确认。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

投资者可在 T+2 日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。

T+1 日，登记结算机构根据基金管理人对于申购、赎回申请的确认信息，为投资者办理组合证券、基金份额的清算交收，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资者 T 日申购所得的基金份额、赎回所得的组

合证券在 T+2 日可用。现金替代和现金差额由基金管理人与申购赎回代理券商于 T+1 日进行清算，T+2 日进行交收，登记结算机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请，登记结算机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻，申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。

如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的其他情形，则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

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

若投资者用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记结算机构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### (六) 申购、赎回的对价、费用

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

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前通知深圳证券交易所及登记结算机构，并在深圳证券交易所及基金管理人网站公告。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

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

#### (七) 申购赎回清单的内容与格式

##### 1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单内容包括最小申购赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T 日预估

现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

## 2、组合证券

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

## 3、现金替代相关内容

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

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

(1) 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代(标志为“禁止”)、可以现金替代(标志为“允许”)和必须现金替代(标志为“必须”)。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

### (2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券经除权调整的 T-1 日收盘价 × (1 + 现金替代保证金率)

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此在 T+2 日收取替代金额。

在 T+1 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日(简称为 T+3 日)内, 基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+3 日日终, 若已购入全部被替代的证券, 则以替代金额与被替代证券的实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额, 确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项; 若未能购入全部被替代的证券, 则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+3 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额, 确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况: 若自 T+1 日起, 相关证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日, 则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额, 确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+3 日后第 1 个工作日(若在特例情况下, 则为 T+1 日起第 21 个交易日), 基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人, 现金替代多退少补资金的清算和交收在 T+3 日后 2 个工作日(若在特例情况下, 则为 T+1 日起第 22 个交易日)内完成, 登记结算机构对此提供代收代付服务。

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

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券数量} \times \text{该证券经除权调整的}T-1\text{日收盘价}}{\text{申购基金份额} \times T-1\text{日基金份额净值}}$$

说明: 假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

### (3) 必须现金替代

①适用情形: 必须现金替代的证券一般是因标的指数调整将被剔除、或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额: 对于必须现金替代的证券, 基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金, 即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的 T-1 日收盘价。

## 4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值, 预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

T 日预估现金差额=T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)

其中，T 日经除权调整后的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数成份证券调整后开盘参考价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额=T 日最小申购赎回单位的资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价乘积之和)

T 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 6、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期：	2021-07-16
基金名称：	500ETF
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	159922
目标指数代码：	399905

2021-07-16 信息内容	
预估现金部分(元):	-3048.51
现金替代比例上限:	50.000%
是否需要公布 IOPV:	是
最小申购、赎回单位(份):	400000
最小申购赎回单位现金红利(元):	0.00
申购赎回组合证券只数:	500
允许申购:	是
允许赎回:	是
当天累计可申购的基金份额上限(份):	不限
当天累计可赎回的基金份额上限(份):	44000000

成分股信息内容								
证券代 码	证券简 称	股份数 量	现金替 代标志	申购现 金替代 保证金 率	赎回现 金替代 保证金 率	申购替 代金额	赎回替 代金额	挂牌市 场
000009	中国宝 安	1,300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000012	南 玻 A	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000021	深科技	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000027	深圳能 源	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000028	国药一 致	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000031	大悦城	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000039	中集集 团	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000046	泛海控 股	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场



000050	深天马 A	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000060	中金岭 南	1,200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000061	农产 品	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000062	深圳华 强	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000078	海王生 物	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000089	深圳机 场	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000090	天健集 团	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000156	华数传 媒		必须	0.000%	0.000%	2,040. 50	2,040. 50	深圳市 场
000158	常山北 明	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000400	许继电 气	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000401	冀东水 泥	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000402	金融 街	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000415	渤海租 赁	1,200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000488	晨鸣纸 业	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000501	鄂武商 A	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000513	丽珠集 团	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

000519	中兵红 箭	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000528	柳工	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000537	广宇发 展	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000540	中天金 融	2,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000547	航天发 展	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000553	安道麦 A	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000559	万向钱 潮	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000563	陕国投 A	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000581	威孚高 科	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000598	兴蓉环 境	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000623	吉林敖 东	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000629	攀钢钒 钛	2,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000630	铜陵有 色	3,600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000636	风华高 科	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000671	阳光城	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000681	视觉中 国	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

000685	中山公用		必须	0.000%	0.000%	3,547.12	3,547.12	深圳市场
000686	东北证券	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000690	宝新能源	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000709	河钢股份	2,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000717	韶钢松山	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000718	苏宁环球	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000723	美锦能源	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000729	燕京啤酒	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000732	泰禾集团	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000738	航发控制	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000739	普洛药业	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000750	国海证券	1,900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000758	中色股份	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000778	新兴铸管	1,200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000799	酒鬼酒	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000807	云铝股份	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

000813	德展健康	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000825	太钢不锈	1,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000826	启迪环境	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000830	鲁西化工	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000869	张裕 A	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000877	天山股份	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000878	云南铜业	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000883	湖北能源	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000887	中鼎股份	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000898	鞍钢股份	1,200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000930	中粮科技	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000932	华菱钢铁	1,600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000937	冀中能源	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000959	首钢股份	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000960	锡业股份	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000961	中南建设	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

000967	盈峰环境	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000970	中科三环	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000975	银泰黄金	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000983	山西焦煤	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000988	华工科技	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000990	诚志股份	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000997	新大陆	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000998	隆平高科	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000999	华润三九	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
001872	招商港口	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
001914	招商积余	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002002	鸿达兴业	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002004	华邦健康	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002010	传化智联	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002013	中航机电	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002019	亿帆医药	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

002028	思源电 气	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002030	达安基 因	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002038	双鹭药 业	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002048	宁波华 翔	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002056	横店东 磁	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002065	东华软 件	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002074	国轩高 科	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002075	沙钢股 份	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002078	太阳纸 业	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002080	中材科 技	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002081	金螳螂	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002085	万丰奥 威	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002092	中泰化 学	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002110	三钢闽 光	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002124	天邦股 份	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002127	南极电 商	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

002128	露天煤业	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002131	利欧股份	3,300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002138	顺络电子	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002146	荣盛发展	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002152	广电运通	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002155	湖南黄金	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002156	通富微电	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002174	游族网络	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002180	纳思达	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002183	怡亚通	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002185	华天科技	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002191	劲嘉股份	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002195	二三四五	2,800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002203	海亮股份	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002212	天融信	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002221	东华能源	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

002223	鱼跃医疗	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002233	塔牌集团	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002242	九阳股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002244	滨江集团	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002249	大洋电机	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002250	联化科技	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002266	浙富控股	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002268	卫士通	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002273	水晶光电	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002281	光迅科技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002294	信立泰	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002299	圣农发展	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002302	西部建设	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002317	众生药业	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002340	格林美	2,400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002353	杰瑞股份	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场



002368	太极股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002372	伟星新材	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002373	千方科技	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002375	亚厦股份	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002382	蓝帆医疗	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002385	大北农	1,600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002387	维信诺	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002390	信邦制药	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002396	星网锐捷	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002399	海普瑞	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002408	齐翔腾达	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002416	爱施德	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002419	天虹股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002422	科伦药业	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002423	中粮资本	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002424	贵州百灵	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

002429	兆驰股份	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002434	万里扬	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002439	启明星辰	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002440	闰土股份	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002444	巨星科技	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002458	益生股份	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002465	海格通信	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002468	申通快递	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002500	山西证券	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002505	鹏都农牧	1,600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002506	协鑫集成	1,700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002507	涪陵榨菜	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002511	中顺洁柔	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002532	天山铝业	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002557	洽洽食品	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002563	森马服饰	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

002572	索菲亚	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002583	海能达	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002595	豪迈科 技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002603	以岭药 业	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002625	光启技 术	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002635	安洁科 技	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002648	卫星石 化	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002653	海思科	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002670	国盛金 控	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002683	宏大爆 破	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002690	美亚光 电	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002701	奥瑞金	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002705	新宝股 份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002709	天赐材 料	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002745	木林森	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002797	第一创 业	1,700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

002815	崇达技术	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002818	富森美	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002831	裕同科技	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002839	张家港行	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002867	周大生	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002901	大博医疗		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	深圳市场
002925	盈趣科技	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002926	华西证券	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002936	郑州银行	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002946	新乳业	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002948	青岛银行	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002958	青农商行	1,400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002966	苏州银行	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002985	北摩高科	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
003022	联泓新科	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
003035	南网能源	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

300001	特锐德	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300002	神州泰 岳	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300009	安科生 物	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300010	豆神教 育	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300017	网宿科 技	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300024	机器人	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300026	红日药 业	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300037	新宙邦	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300058	蓝色光 标	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300070	碧水源	1,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300072	三聚环 保	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300088	长信科 技	1,200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300113	顺网科 技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300115	长盈精 密	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300133	华策影 视	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
300146	汤臣倍 健	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

300166	东方国信	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300168	万达信息	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300180	华峰超纤	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300182	捷成股份	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300207	欣旺达	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300212	易华录	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300223	北京君正	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300244	迪安诊断	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300251	光线传媒	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300253	卫宁健康	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300257	开山股份	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300271	华宇软件	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300285	国瓷材料	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300296	利亚德	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300308	中际旭创	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300315	掌趣科技	1,400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

300316	晶盛机电	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300357	我武生物	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300376	易事特	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300383	光环新网	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300418	昆仑万维	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300463	迈克生物	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300474	景嘉微	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300482	万孚生物	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300618	寒锐钴业	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300630	普利制药	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300699	光威复材	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300741	华宝股份	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
600006	东风汽车	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600008	首创环保	2,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600021	上海电力	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600022	山东钢铁	2,700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600026	中远海能	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600027	华电国际	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600037	歌华有线	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600038	中直股份	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600039	四川路桥	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600056	中国医药	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600060	海信视像	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600062	华润双鹤	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600064	南京高科	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600066	宇通客车	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600068	葛洲坝	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600089	特变电工	1,800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600094	大名城	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600095	湘财股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600120	浙江东方	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600126	杭钢股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场



600131	国网信通	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600141	兴发集团	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600153	建发股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600155	华创阳安	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600158	中体产业	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600160	巨化股份	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600166	福田汽车	2,300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600167	联美控股	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600170	上海建工	2,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600171	上海贝岭	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600177	雅戈尔	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600188	兖州煤业	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600195	中牧股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600201	生物股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600208	新湖中宝	2,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600216	浙江医药	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600219	南山铝业	3,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600256	广汇能源	2,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600258	首旅酒店	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600259	广晟有色	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600260	凯乐科技	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600266	城建发展	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600271	航天信息		必须	0.000%	0.000%	7,224.84	7,224.84	上海市场
600282	南钢股份	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600307	酒钢宏兴	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600312	平高电气	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600315	上海家化	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600316	洪都航空	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600325	华发股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600329	中新药业	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600339	中油工程	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600348	华阳股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600350	山东高速	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600369	西南证券	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600372	中航电子	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600373	中文传媒	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600376	首开股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600377	宁沪高速	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600380	健康元	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600388	龙净环保	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600390	五矿资本	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600392	盛和资源	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600398	海澜之家	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600409	三友化工	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600410	华胜天成	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600415	小商品城	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600418	江淮汽车	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600435	北方导航	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600446	金证股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600460	士兰微	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600466	蓝光发展	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600486	扬农化工	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600487	亨通光电	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600497	驰宏锌锗	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600498	烽火通信	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600500	中化国际	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600507	方大特钢	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600511	国药股份	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600516	方大炭素	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600517	国网英大	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600528	中铁工业	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600529	山东药玻	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600535	天士力	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600536	中国软件	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600546	山煤国际	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600549	厦门钨业	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600556	天下秀	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600563	法拉电子	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600566	济川药业	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600567	山鹰国际	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600572	康恩贝	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600580	卧龙电驱		必须	0.000%	0.000%	5,130.91	5,130.91	上海市场
600582	天地科技	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600597	光明乳业	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600598	北大荒	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600623	华谊集团	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600633	浙数文化	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600637	东方明珠	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600639	浦东金桥	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600640	号百控股	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600642	申能股份	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600643	爱建集团	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600645	中源协和	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600648	外高桥	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600649	城投控股	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600657	信达地产	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600663	陆家嘴	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600667	太极实业	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600673	东阳光	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600699	均胜电子	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600704	物产中大	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600707	彩虹股份	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600717	天津港	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600718	东软集团	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600728	佳都科技	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600729	重庆百货	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600732	爱旭股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600733	北汽蓝谷	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600737	中粮糖业	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600739	辽宁成大	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600754	锦江酒店	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600755	厦门国贸	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600764	中国海防	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600765	中航重机	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600776	东方通信	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600779	水井坊	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600782	新钢股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600787	中储股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600801	华新水泥	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600803	新奥股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600804	鹏博士	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600808	马钢股份	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600811	东方集团	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600820	隧道股份	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600823	世茂股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600827	百联股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600835	上海机电	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600839	四川长虹	1,800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600859	王府井	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600862	中航高科	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600863	内蒙华电	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600867	通化东宝	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600871	石化油服	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600875	东方电气	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600879	航天电子	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600881	亚泰集团	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600884	杉杉股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600885	宏发股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场



600895	张江高科	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600901	江苏租赁	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600903	贵州燃气	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600908	无锡银行	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600909	华安证券	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600917	重庆燃气	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600928	西安银行	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600956	新天绿能	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600959	江苏有线	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600967	内蒙一机	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600968	海油发展	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600970	中材国际	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600985	淮北矿业	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600988	赤峰黄金	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600998	九州通	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601000	唐山港	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

601003	柳钢股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601005	重庆钢铁	3,300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601016	节能风电	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601068	中铝国际	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601098	中南传媒	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601099	太平洋	3,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601106	中国一重	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601117	中国化学	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601118	海南橡胶	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601127	小康股份	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601128	常熟银行	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601139	深圳燃气	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601168	西部矿业	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601179	中国西电	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601187	厦门银行	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601198	东兴证券	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

601200	上海环境	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601228	广州港	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601233	桐昆股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601298	青岛港	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601333	广深铁路	1,700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601456	国联证券	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601512	中新集团	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601568	北元集团	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601577	长沙银行	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601598	中国外运	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601608	中信重工	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601611	中国核建	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601615	明阳智能	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601636	旗滨集团	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601689	拓普集团	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601699	潞安环能	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

601717	郑煤机	500	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601718	际华集 团	1,300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601778	晶科科 技	400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601801	皖新传 媒	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601828	美凯龙	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601860	紫金银 行	900	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601866	中远海 发	2,000	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601869	长飞光 纤	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601880	辽港股 份	2,600	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601928	凤凰传 媒	400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601958	金钼股 份	500	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601969	海南矿 业	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601975	招商南 油	1,700	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601991	大唐发 电	1,200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601992	金隅集 团	2,100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601997	贵阳银 行	1,300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场

603000	人民网	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603056	德邦股 份	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603077	和邦生 物	2,600	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603156	养元饮 品	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603198	迎驾贡 酒	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603225	新风鸣	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603228	景旺电 子	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603256	宏和科 技	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603260	合盛硅 业	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603290	斯达半 导		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603317	天味食 品	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603355	莱克电 气	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603377	东方时 尚	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603379	三美股 份	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603444	吉比特		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603486	科沃斯	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场

603515	欧普照明	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603568	伟明环保	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603589	口子窖	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603605	珀莱雅	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603638	艾迪精密	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603650	彤程新材	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603707	健友股份	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603708	家家悦	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603712	七一二	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603719	良品铺子		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603737	三棵树	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603786	科博达		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603858	步长制药	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603866	桃李面包	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603868	飞科电器		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603883	老百姓	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

603885	吉祥航空	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603888	新华网	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603893	瑞芯微	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603927	中科软	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603983	丸美股份		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
605358	立昂微		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688002	睿创微纳	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688029	南微医学		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688088	虹软科技	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688099	晶晨股份	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688208	道通科技	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688321	微芯生物	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

#### （八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购、赎回申请。
2. 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单。
5. 相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编

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

6. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7. 基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人或者其他申购、赎回投资人利益的其他情形。

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

9. 法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一（第 6 项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

二、场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申购赎回

（一）申购与赎回的场所

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

基金管理人在开始办理申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并予以公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1. 开放日及开放时间

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

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》的有关规定在指定媒体上公告。

2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式的业务开始时间后，



基金管理人应在开始办理申购、赎回前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记结算机构确认接受的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回申请，并按照下一开放日的申请处理。

### （三）申购与赎回的原则

1. 基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
2. 基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
3. 申购、赎回申请提交后不得撤销。
4. 申购、赎回应遵守深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则、通知或指南等规定。
5. 基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，或依据深圳证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整，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》的有关规定在指定媒体上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1. 申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2. 申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

投资者申购的基金份额当日起可卖出；投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

#### 3. 申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。

投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的登记与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金

差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

基金管理人、深圳证券交易所、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对基金份额申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，基金管理人应最迟于新规则开始实施前在至少一种指定媒体公告。

#### （五）申购和赎回的数量限制

1. 投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素在不违反相关法律法规的情况下对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。目前，本基金最小申购赎回单位为 45 万份。

2. 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份额上限、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。

3. 基金管理人可以根据市场情况、市场变化以及投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购和赎回的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购和赎回的对价、费用及其用途

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

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

3. T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购

赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间进行调整并提前公告。

### （七）申购赎回清单的内容与格式

#### 1. 申购赎回清单的内容

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

#### 2. 申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记结算机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

#### 3. 组合证券相关内容

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

#### 4. 现金替代相关内容

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

##### （1）

现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于所有成份股。

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

当可以现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

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

## （2）可以现金替代

### 【1】对于深市成份证券

①适用情形：投资者申购时持仓不足的深市成份证券。登记结算机构先用深市成份证券，不足时差额部分用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。

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

### ③替代金额的处理程序

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

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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

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

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

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum (\text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格})}{\text{申购基金份额} \times \text{T} - 1 \text{ 日基金份额净值}} \times 100\%$$

如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。

## 【2】对于沪市成份证券

①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的沪市成份证券，替代金额的计算公式为：

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

赎回替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 - 现金替代折价比例)

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

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

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

### ③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在上交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。

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

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

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

入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

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

特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

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

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

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要设置必须现金替代的成份证券。

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

## 5. 预估现金差额相关内容

预估现金差额是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金差额。其计算公式为：

T 日预估现金差额=T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额之和+申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和）

其中，该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

#### 6. 现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额=T 日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额之和+申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券 T 日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券 T 日收盘价相乘之和）

T 日投资者申购赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 7. 申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期：	2021-07-16
基金名称：	500ETF
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	159922



目标指数代码：	399905
---------	--------

2021-07-16 信息内容	
预估现金部分(元)：	-3048.51
现金替代比例上限：	50.000%
是否需要公布 IOPV：	是
最小申购、赎回单位(份)：	400000
最小申购赎回单位现金红利(元)：	0.00
申购赎回组合证券只数：	500
允许申购：	是
允许赎回：	是
当天累计可申购的基金份额上限(份)：	不限
当天累计可赎回的基金份额上限(份)：	44000000

成分股信息内容								
证券代 码	证券简 称	股份数 量	现金替 代标志	申购现 金替代 保证金 率	赎回现 金替代 保证金 率	申购替 代金额	赎回替 代金额	挂牌市 场
000009	中国宝 安	1,300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000012	南 玻 A	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000021	深科技	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000027	深圳能 源	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000028	国药一 致	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000031	大悦城	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
000039	中集集 团	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场

000046	泛海控股	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000050	深天马 A	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000060	中金岭南	1,200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000061	农产品	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000062	深圳华强	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000078	海王生物	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000089	深圳机场	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000090	天健集团	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000156	华数传媒		必须	0.000%	0.000%	2,040.50	2,040.50	深圳市场
000158	常山北明	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000400	许继电气	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000401	冀东水泥	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000402	金融街	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000415	渤海租赁	1,200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000488	晨鸣纸业	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000501	鄂武商 A	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

000513	丽珠集团	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000519	中兵红箭	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000528	柳工	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000537	广宇发展	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000540	中天金融	2,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000547	航天发展	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000553	安道麦 A	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000559	万向钱潮	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000563	陕国投 A	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000581	威孚高科	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000598	兴蓉环境	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000623	吉林敖东	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000629	攀钢钒钛	2,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000630	铜陵有色	3,600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000636	风华高科	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
000671	阳光城	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

000681	视觉中国	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000685	中山公用		必须	0.000%	0.000%	3,547.12	3,547.12	深圳市场
000686	东北证券	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000690	宝新能源	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000709	河钢股份	2,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000717	韶钢松山	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000718	苏宁环球	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000723	美锦能源	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000729	燕京啤酒	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000732	泰禾集团	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000738	航发控制	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000739	普洛药业	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000750	国海证券	1,900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000758	中色股份	700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000778	新兴铸管	1,200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000799	酒鬼酒	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

000807	云铝股份	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000813	德展健康	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000825	太钢不锈	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000826	启迪环境	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000830	鲁西化工	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000869	张裕 A	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000877	天山股份	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000878	云南铜业	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000883	湖北能源	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000887	中鼎股份	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000898	鞍钢股份	1,200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000930	中粮科技	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000932	华菱钢铁	1,600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000937	冀中能源	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000959	首钢股份	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000960	锡业股份	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

000961	中南建设	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000967	盈峰环境	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000970	中科三环	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000975	银泰黄金	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000983	山西焦煤	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000988	华工科技	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000990	诚志股份	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000997	新大陆	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000998	隆平高科	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
000999	华润三九	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
001872	招商港口	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
001914	招商积余	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002002	鸿达兴业	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002004	华邦健康	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002010	传化智联	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002013	中航机电	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

002019	亿帆医药	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002028	思源电气	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002030	达安基因	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002038	双鹭药业	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002048	宁波华翔	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002056	横店东磁	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002065	东华软件	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002074	国轩高科	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002075	沙钢股份	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002078	太阳纸业	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002080	中材科技	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002081	金螳螂	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002085	万丰奥威	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002092	中泰化学	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002110	三钢闽光	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002124	天邦股份	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

002127	南极电 商	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002128	露天煤 业	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002131	利欧股 份	3,300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002138	顺络电 子	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002146	荣盛发 展	1,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002152	广电运 通	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002155	湖南黄 金	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002156	通富微 电	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002174	游族网 络	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002180	纳思达	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002183	怡亚通	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002185	华天科 技	1,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002191	劲嘉股 份	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002195	二三四 五	2,800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002203	海亮股 份	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场
002212	天融信	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市 场



002221	东华能源	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002223	鱼跃医疗	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002233	塔牌集团	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002242	九阳股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002244	滨江集团	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002249	大洋电机	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002250	联化科技	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002266	浙富控股	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002268	卫士通	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002273	水晶光电	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002281	光迅科技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002294	信立泰	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002299	圣农发展	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002302	西部建设	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002317	众生药业	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002340	格林美	2,400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

002353	杰瑞股份	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002368	太极股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002372	伟星新材	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002373	千方科技	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002375	亚厦股份	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002382	蓝帆医疗	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002385	大北农	1,600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002387	维信诺	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002390	信邦制药	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002396	星网锐捷	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002399	海普瑞	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002408	齐翔腾达	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002416	爱施德	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002419	天虹股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002422	科伦药业	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002423	中粮资本	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

002424	贵州百灵	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002429	兆驰股份	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002434	万里扬	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002439	启明星辰	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002440	闰土股份	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002444	巨星科技	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002458	益生股份	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002465	海格通信	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002468	申通快递	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002500	山西证券	1,100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002505	鹏都农牧	1,600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002506	协鑫集成	1,700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002507	涪陵榨菜	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002511	中顺洁柔	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002532	天山铝业	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002557	洽洽食品	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

002563	森马服饰	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002572	索菲亚	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002583	海能达	500	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002595	豪迈科技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002603	以岭药业	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002625	光启技术	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002635	安洁科技	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002648	卫星石化	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002653	海思科	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002670	国盛金控	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002683	宏大爆破	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002690	美亚光电	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002701	奥瑞金	800	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002705	新宝股份	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002709	天赐材料	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
002745	木林森	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

002797	第一创业	1,700	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002815	崇达技术	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002818	富森美	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002831	裕同科技	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002839	张家港行	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002867	周大生	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002901	大博医疗		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	深圳市场
002925	盈趣科技	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002926	华西证券	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002936	郑州银行	900	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002946	新乳业	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002948	青岛银行	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002958	青农商行	1,400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002966	苏州银行	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
002985	北摩高科	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
003022	联泓新科	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

003035	南网能源	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300001	特锐德	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300002	神州泰岳	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300009	安科生物	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300010	豆神教育	300	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300017	网宿科技	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300024	机器人	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300026	红日药业	900	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300037	新宙邦	100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300058	蓝色光标	1,000	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300070	碧水源	1,100	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300072	三聚环保	700	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300088	长信科技	1,200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300113	顺网科技	200	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300115	长盈精密	400	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场
300133	华策影视	600	允许	21.000 %	30.000 %	0.00	0.00	深圳市场

300146	汤臣倍健	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300166	东方国信	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300168	万达信息	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300180	华峰超纤	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300182	捷成股份	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300207	欣旺达	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300212	易华录	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300223	北京君正	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300244	迪安诊断	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300251	光线传媒	600	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300253	卫宁健康	800	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300257	开山股份	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300271	华宇软件	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300285	国瓷材料	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300296	利亚德	1,000	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300308	中际旭创	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场

300315	掌趣科技	1,400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300316	晶盛机电	300	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300357	我武生物	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300376	易事特	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300383	光环新网	500	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300418	昆仑万维	400	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300463	迈克生物	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300474	景嘉微	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300482	万孚生物	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300618	寒锐钴业	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300630	普利制药	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300699	光威复材	200	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
300741	华宝股份	100	允许	21.000%	30.000%	0.00	0.00	深圳市场
600006	东风汽车	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600008	首创环保	2,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600021	上海电力	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场



600022	山东钢铁	2,700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600026	中远海能	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600027	华电国际	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600037	歌华有线	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600038	中直股份	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600039	四川路桥	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600056	中国医药	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600060	海信视像	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600062	华润双鹤	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600064	南京高科	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600066	宇通客车	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600068	葛洲坝	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600089	特变电工	1,800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600094	大名城	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600095	湘财股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600120	浙江东方	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600126	杭钢股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600131	国网通信	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600141	兴发集团	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600153	建发股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600155	华创阳安	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600158	中体产业	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600160	巨化股份	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600166	福田汽车	2,300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600167	联美控股	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600170	上海建工	2,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600171	上海贝岭	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600177	雅戈尔	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600188	兖州煤业	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600195	中牧股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600201	生物股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600208	新潮中宝	2,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600216	浙江医药	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600219	南山铝业	3,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600256	广汇能源	2,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600258	首旅酒店	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600259	广晟有色	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600260	凯乐科技	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600266	城建发展	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600271	航天信息		必须	0.000%	0.000%	7,224.84	7,224.84	上海市场
600282	南钢股份	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600307	酒钢宏兴	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600312	平高电气	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600315	上海家化	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600316	洪都航空	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600325	华发股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600329	中新药业	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600339	中油工程	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600348	华阳股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600350	山东高速	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600369	西南证券	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600372	中航电子	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600373	中文传媒	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600376	首开股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600377	宁沪高速	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600380	健康元	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600388	龙净环保	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600390	五矿资本	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600392	盛和资源	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600398	海澜之家	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600409	三友化工	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600410	华胜天成	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600415	小商品城	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600418	江淮汽车	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600435	北方导航	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600446	金证股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600460	士兰微	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600466	蓝光发展	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600486	扬农化工	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600487	亨通光电	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600497	驰宏锌锗	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600498	烽火通信	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600500	中化国际	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600507	方大特钢	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600511	国药股份	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600516	方大炭素	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600517	国网英大	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600528	中铁工业	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600529	山东药玻	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600535	天士力	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600536	中国软件	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600546	山煤国际	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600549	厦门钨业	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600556	天下秀	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600563	法拉电子	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600566	济川药业	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600567	山鹰国际	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600572	康恩贝	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600580	卧龙电驱		必须	0.000%	0.000%	5,130.91	5,130.91	上海市场
600582	天地科技	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600597	光明乳业	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600598	北大荒	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600623	华谊集团	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600633	浙数文化	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600637	东方明珠	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600639	浦东金桥	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600640	号百控股	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600642	申能股份	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600643	爱建集团	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600645	中源协和	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600648	外高桥	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600649	城投控股	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600657	信达地产	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600663	陆家嘴	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600667	太极实业	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600673	东阳光	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600699	均胜电子	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600704	物产中大	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600707	彩虹股份	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600717	天津港	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600718	东软集团	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600728	佳都科技	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600729	重庆百货	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600732	爱旭股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600733	北汽蓝谷	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600737	中粮糖业	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600739	辽宁成大	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600754	锦江酒店	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600755	厦门国贸	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600764	中国海防	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600765	中航重机	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600776	东方通信	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600779	水井坊	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600782	新钢股份	800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600787	中储股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600801	华新水泥	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600803	新奥股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600804	鹏博士	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场



600808	马钢股份	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600811	东方集团	1,500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600820	隧道股份	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600823	世茂股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600827	百联股份	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600835	上海机电	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600839	四川长虹	1,800	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600859	王府井	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600862	中航高科	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600863	内蒙华电	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600867	通化东宝	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600871	石化油服	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600875	东方电气	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600879	航天电子	1,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600881	亚泰集团	1,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600884	杉杉股份	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

600885	宏发股份	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600895	张江高科	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600901	江苏租赁	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600903	贵州燃气	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600908	无锡银行	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600909	华安证券	1,400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600917	重庆燃气	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600928	西安银行	700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600956	新天绿能	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600959	江苏有线	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600967	内蒙一机	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600968	海油发展	1,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600970	中材国际	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600985	淮北矿业	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600988	赤峰黄金	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
600998	九州通	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

601000	唐山港	1,500	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601003	柳钢股 份	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601005	重庆钢 铁	3,300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601016	节能风 电	1,500	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601068	中铝国 际	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601098	中南传 媒	400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601099	太平洋	3,400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601106	中国一 重	1,400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601117	中国化 学	1,200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601118	海南橡 胶	900	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601127	小康股 份	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601128	常熟银 行	1,400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601139	深圳燃 气	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601168	西部矿 业	900	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601179	中国西 电	1,000	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601187	厦门银 行	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场

601198	东兴证 券	700	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601200	上海环 境	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601228	广州港	600	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601233	桐昆股 份	800	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601298	青岛港	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601333	广深铁 路	1,700	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601456	国联证 券	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601512	中新集 团	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601568	北元集 团	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601577	长沙银 行	600	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601598	中国外 运	800	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601608	中信重 工	900	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601611	中国核 建	400	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601615	明阳智 能	500	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601636	旗滨集 团	800	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
601689	拓普集 团	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场

601699	潞安环能	600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601717	郑煤机	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601718	际华集团	1,300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601778	晶科科技	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601801	皖新传媒	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601828	美凯龙	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601860	紫金银行	900	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601866	中远海发	2,000	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601869	长飞光纤	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601880	辽港股份	2,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601928	凤凰传媒	400	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601958	金钼股份	500	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601969	海南矿业	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601975	招商南油	1,700	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601991	大唐发电	1,200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
601992	金隅集团	2,100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

601997	贵阳银行	1,300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603000	人民网	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603056	德邦股份	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603077	和邦生物	2,600	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603156	养元饮品	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603198	迎驾贡酒	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603225	新凤鸣	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603228	景旺电子	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603256	宏和科技	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603260	合盛硅业	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603290	斯达半导		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603317	天味食品	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603355	莱克电气	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603377	东方时尚	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603379	三美股份	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603444	吉比特		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

603486	科沃斯	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603515	欧普照 明	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603568	伟明环 保	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603589	口子窖	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603605	珀莱雅	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603638	艾迪精 密	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603650	彤程新 材	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603707	健友股 份	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603708	家家悦	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603712	七一二	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603719	良品铺 子		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603737	三棵树	100	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603786	科博达		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603858	步长制 药	300	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603866	桃李面 包	200	允许	21.000 %	0.000%	0.00	0.00	上海市 场
603868	飞科电 器		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市 场

603883	老百姓	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603885	吉祥航空	300	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603888	新华网	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603893	瑞芯微	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603927	中科软	200	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
603983	丸美股份		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
605358	立昂微		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688002	睿创微纳	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688029	南微医学		必须	0.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688088	虹软科技	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688099	晶晨股份	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688208	道通科技	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场
688321	微芯生物	100	允许	21.000%	0.000%	0.00	0.00	上海市场

#### (八) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购、赎回申请。
2. 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单。



5. 相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

6. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7. 基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人或者其他申购、赎回投资人利益的其他情形。

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

9. 法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一（第 6 项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时，基金管理人应在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 十一、基金的非交易过户等其他业务

登记结算机构可依据其业务规则受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并按照规定收取一定的手续费用。

基金登记结算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，以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### （二）投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

### （三）投资策略

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货后，基金管理人应在季度报告、半年度报告、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。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

#### 1、决策依据

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

#### 2、投资管理体制

投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

#### 3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，基金经理主要以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当指数投资的方法，以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行：中央交易部门负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

#### （四）投资组合管理

##### 1、投资组合的建立

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用其他指数投资技术作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。这些情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用其他指数投资技术保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，采用其他指数投资技术能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无法及时买入成份股；5) 其它需要采用非完全复制指数投资技术的情形。

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

- （1）确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。
- （2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。
- （3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

##### 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用指数投资管理系统，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

根据标的指数的编制规则及指数样本股的定期调整或临时调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来跟踪误差。

### 4、投资绩效评估

风险管理部门每日提供投资绩效评估报告，基金经理据此分析基金的跟踪偏离情况，分析跟踪误差的产生原因。

## （五）标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：中证 500 指数。

中证 500 指数由沪深 A 股市场中经营状况良好、价格无异常波动或市场操纵的 500 只股票组成，以调整股本为权数，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。

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。

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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### （七） 禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

如果法律法规或中国证监会的相关规定对本基金合同约定投资禁止行为进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述投资禁止行为，如适用于本基金，本基金可相应调整禁止行为。

#### （八） 投资限制

- (1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

(2) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。

(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金投资于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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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；

(9) 基金资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；

(10) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(11) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；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）不得超过基金资产净值的 100%；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

(12) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%。



(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本款所规定比例限制的，本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) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

(16) 法律法规、基金合同规定的其他限制。

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

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

除第（8）、（13）、（14）项外，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、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3. 有利于基金财产的安全与增值；

4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （十）基金投资组合报告

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

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 6 月 30 日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

## 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,515,265,156.98	96.67
	其中：股票	2,515,265,156.98	96.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	645,000.00	0.02
	其中：债券	645,000.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	33,000,000.00	1.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	39,527,604.67	1.52
8	其他资产	13,433,479.91	0.52
9	合计	2,601,871,241.56	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 563,514,767.80 元，占基金资产净值的比例为 21.69%。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	24,622,287.75	0.95
B	采矿业	78,526,770.93	3.02
C	制造业	1,594,833,474.43	61.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,663,229.25	2.33
E	建筑业	46,392,671.11	1.79
F	批发和零售业	85,789,368.43	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	48,503,849.65	1.87
H	住宿和餐饮业	13,375,752.45	0.51
I	信息传输、软件和信息技术	208,231,404.50	8.01

	术服务业		
J	金融业	147,048,867.66	5.66
K	房地产业	81,978,079.63	3.16
L	租赁和商务服务业	33,210,502.76	1.28
M	科学研究和技术服务业	6,613,554.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	21,333,761.23	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,596,059.76	0.06
Q	卫生和社会工作	6,820,732.10	0.26
R	文化、体育和娱乐业	25,287,950.48	0.97
S	综合	27,641,150.81	1.06
	合计	2,512,469,466.93	96.70

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,535,109.11	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	39,993.82	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,806.50	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,793,093.05	0.11

**(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

无。

**3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细****(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002709	天赐材料	234,563	24,999,724.54	0.96
2	000799	酒鬼酒	93,300	23,847,480.00	0.92
3	603486	科沃斯	93,926	21,422,642.08	0.82
4	600089	特变电工	1,523,642	19,578,799.70	0.75
5	000009	中国宝安	1,058,025	19,330,116.75	0.74
6	002340	格林美	1,962,306	18,347,561.10	0.71
7	002074	国轩高科	420,227	18,305,088.12	0.70
8	600460	士兰微	322,503	18,173,044.05	0.70
9	300285	国瓷材料	329,386	16,057,567.50	0.62
10	601233	桐昆股份	656,800	15,822,312.00	0.61

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
2	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.01
3	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
4	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
5	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00

**(3) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细**

无。

**4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	645,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	645,000.00	0.02

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113051	节能转债	6,450	645,000.00	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

无。

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

无。

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

无。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2107	IC2107	60	81,206,400.00	1,695,200.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,695,200.00
股指期货投资本期收益（元）					8,675,495.15
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-107,400.00

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金

投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

无。

### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### (3) 本期国债期货投资评价

无。

## 11. 投资组合报告附注

### (1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

### (2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,010,775.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,117,898.58
4	应收利息	304,805.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,433,479.91

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	4,468,555.00	0.17	转融通出借证券
2	600460	士兰微	13,704,489.05	0.53	重大事项停牌
3	002709	天赐材料	6,139,008.00	0.24	转融通出借证券
4	600089	特变电工	4,812,325.00	0.19	转融通出借证券
5	000009	中国宝安	4,750,200.00	0.18	转融通出借证券
6	002340	格林美	4,510,440.00	0.17	转融通出借证券
7	002074	国轩高科	4,499,748.00	0.17	转融通出借证券
8	300285	国瓷材料	3,943,875.00	0.15	转融通出借证券
9	601233	桐昆股份	3,888,126.00	0.15	转融通出借证券
10	000799	酒鬼酒	3,348,360.00	0.13	转融通出借证券

**②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688626	翔宇医疗	380,392.32	0.01	新股锁定
2	688317	之江生物	366,326.80	0.01	新股锁定
3	688665	四方光电	218,399.02	0.01	新股锁定
4	300957	贝泰妮	214,921.88	0.01	新股锁定
5	688625	呈和科技	113,907.36	0.00	新股锁定

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

### 十三、基金的业绩

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

#### （一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

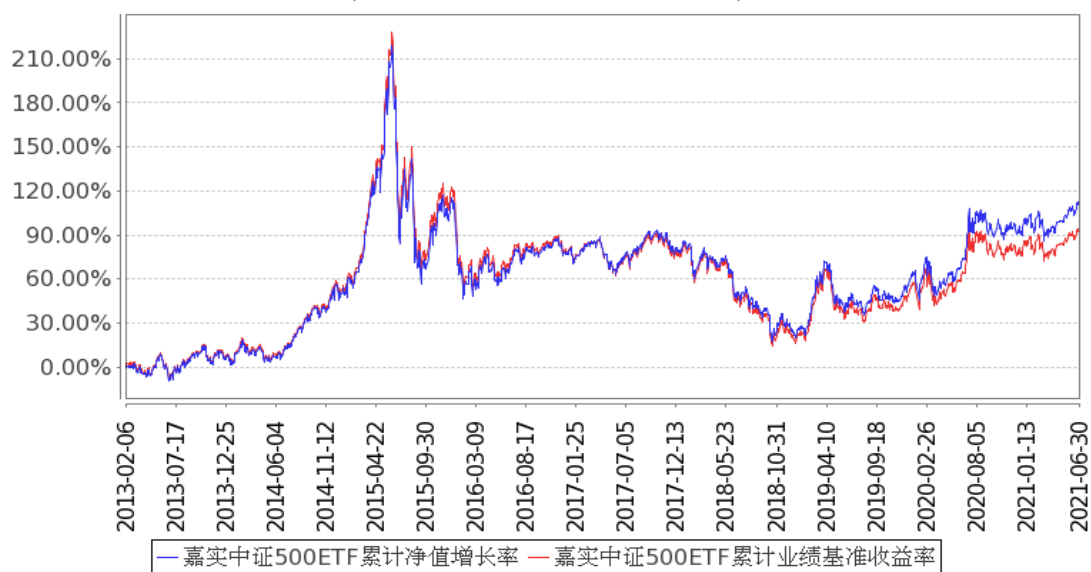
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013 年 2 月 6 日 （基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	7.58%	1.41%	8.76%	1.45%	-1.18%	-0.04%
2014 年	38.49%	1.23%	39.01%	1.24%	-0.52%	-0.01%
2015 年	40.06%	2.81%	43.12%	2.82%	-3.06%	-0.01%
2016 年	-15.27%	1.85%	-17.78%	1.90%	2.51%	-0.05%
2017 年	1.87%	0.92%	-0.20%	0.93%	2.07%	-0.01%
2018 年	-32.24%	1.51%	-33.32%	1.51%	1.08%	0.00%
2019 年	28.00%	1.47%	26.38%	1.47%	1.62%	0.00%
2020 年	25.02%	1.61%	20.87%	1.62%	4.15%	-0.01%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	8.44%	0.99%	6.93%	0.99%	1.51%	0.00%

历任基金经理：杨宇先生，管理时间为 2013 年 2 月 6 日至 2016 年 1 月 5 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 1 月 5 日至 2021 年 9 月 24 日。

#### （二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



**嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2013年02月06日至2021年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 十四、基金的融资融券及转融通

本基金可以根据届时有效的法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

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

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

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

## 十六、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

6、中小企业私募债，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。

7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

8、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-7 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为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。

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

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

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

#### （四）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

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

5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （六）基金份额净值的确认

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

#### （七）估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

##### 2. 差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

(6) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

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

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### （八）特殊情形的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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



## 十七、基金收益与分配

### （一）收益分配原则

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；
3. 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
5. 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；
7. 本基金收益分配采取现金分红；
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （二）基金收益分配数额的确定原则

1. 在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。  
截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配。
2. 当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

### （五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十八、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金资产的资金汇划费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
8. 基金的开户费用、账户维护费用；
9. 基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
10. 基金的上市费和年费；
11. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
12. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

### （三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

### 3. 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

#### (1) 许可使用基点费

指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

#### (2) 具体计费方式：

(i) 就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同）大于人民币 5000 万元的，本基金应支付的许可使用基点费为下述 (a)、(b) 两项金额中的较高者：

(a) 根据上述第 (1) 条计费公式按照基金当季存续天数所计算的许可使用基点费；

(b) 下限金额/当季天数×基金当季存续日的天数。（下限金额为人民币 35,000 元）

(ii) 就每个计费季度而言，如该季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，本基金该计费季度应支付的许可使用基点费应根据上述第 (1) 条计费公式按照基金当季存续日的天数进行计算。

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

#### (四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

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

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十九、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会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 二十、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，依法披露基金信息，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及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露。本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人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。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

### （二）基金合同、托管协议

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

### （三）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

#### （四）基金产品资料概要

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

#### （五）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日，下同）在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

#### （六）基金净值信息

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值；

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

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

#### （七）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日提前 2 日在指定报刊和网站上公告。

#### （八）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

#### （九）基金份额上市交易公告书

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

#### （十）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应至少提前 2 日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

#### （十一）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计；

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

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

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

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基金定期报告“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产品的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### (十二) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议及决定的事项；
2. 基金合同终止、基金清算；
3. 转换基金运作方式、基金合并；
4. 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
5. 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
6. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
7. 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
8. 基金募集期延长；
9. 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
10. 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；
11. 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼；



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、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17. 本基金开始办理申购、赎回；

18. 本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

19. 变更标的指数；

20. 基金份额暂停、恢复、终止上市交易；

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

#### （十三）澄清公告

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

#### （十四）清算报告

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

#### （十五）中国证监会规定的其他信息

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

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （十六）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、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

#### （十七）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、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒介上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十一、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### （4）购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，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

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### （二）本基金特有的风险

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 2、标的指数波动的风险

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

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

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

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

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

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

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

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

#### 4、标的指数变更的风险

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

#### 5、指数编制机构停止服务的风险

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

#### 6、成份股停牌的风险

本基金的标的指数成份股可能出现停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，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风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后对相关成份股进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

#### 7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 8、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司计算基金份额参考净值（IOPV），并由深圳证券交易所交易时间发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

#### 9、退市风险

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

#### 10、投资者申购失败的风险

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代。因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

#### 11、投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

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

#### 12、基金份额赎回对价的变现风险

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

#### 13、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

（2）登记结算机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

（3）证券交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### 14、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在

法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### （三）信用风险

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

### （四）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### （1）本基金的申购、赎回安排

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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （2）拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，经考察中证 500 指数的成份股数量、日均成交量以及日均成交金额，该指数将具有充足的流动性可满足本基金投资的要求；本基金在组合构建过程中，将根据开放日申购和赎回情况，决定投资标的指数成份股及备选成份股的时间和方式，如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。因此，本基金拟投资市场及资产的流动性良好。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

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

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

#### （五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### （六）操作或技术风险

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

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

#### （七）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （八）其它风险

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

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

#### （九）风险声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十二、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

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

### （二）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

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

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

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

#### 2. 基金财产清算程序

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

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



(10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

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

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金合同内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金份额持有人的权利与义务

（1）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开或自行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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 及时足额交纳基金份额认购、申购对价和赎回对价及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及/或基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7) 遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
- 8) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 2、基金管理人的权利与义务

（1）基金管理人的权利

- 1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3) 发售基金份额；

4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5) 在符合有关法律法规、基金合同、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、收益分配等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

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

7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券和参与转融通；

9) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

10) 以基金管理人的名义，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；

11) 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

12) 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

13) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

14) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

15) 依法召集基金份额持有人大会；

16) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

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

2) 办理基金备案手续；

3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购或赎回之基金份额的对价；

11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

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

17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

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

22) 要求登记结算机构向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

（1）基金托管人的权利

- 1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- 4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 6) 依法召集基金份额持有人大会；
- 7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- 8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

- 1) 安全保管基金财产；
- 2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户；
- 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 8) 对基金财务会计报告、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；
- 9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回对价的现金部分；
- 13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23) 建立并保存基金份额持有人名册；

24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人出席会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金（即“嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

### （A）召开事由

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

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会决定修改基金合同的其他事项；

(11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相关的法律法规、监管机关的监管规则、相关证券交易所或者登记结算机构业务规则等发生变动，且本基金须遵照执行的，本基金合同相应进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(7) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(B) 召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否

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

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

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(C) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 会议形式；

(4) 议事程序；

(5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

(6) 代理投票的授权委托书证明的内容要求(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；

(7) 表决方式；

(8) 会务常设联系人姓名、电话；

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(D) 基金份额持有人出席会议的方式



## 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

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

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 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。

(5) 会议的召开方式由召集人确定。

## 2. 召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

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

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

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在表决截止日前发布至少 2 次相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

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

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

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

6) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

(E) 议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

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

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

2. 议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。现场开会可由召集人聘请公证机关现场监督。

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

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、企业法人营业执照号码(事业单位法人证书编号)、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)及其身份证号码、企业法人营业执照号码(事业单位法人证书编号)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(F) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

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

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

(G) 计票

1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

## 2. 通讯方式开会

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

(H) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(I) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金合同解除和终止的理由、程序

(A) 有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1 基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4. 中国证监会规定的其他情况。

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

(B) 基金财产的清算

1. 基金财产清算组

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

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

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

## 2. 基金财产清算程序

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

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

## 3. 清算费用

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

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

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

## 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （四）争议解决方式

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

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

本基金合同受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十四、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

法定代表人：经雷

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】5 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5 亿元人民币

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

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

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金

托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

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

(1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

(2) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金投资于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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

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



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

(9) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%，经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；因流通受限证券价格波动、基金规模变动、上市公司合并等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券并在流通受限期结束后卖出流通受限证券；

(10) 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%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金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）不得超过基金资产净值的 100%；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%。

(12) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(13) 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；

(14) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算。

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

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

除第（7）、（12）、（13）项外，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、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

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

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

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

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

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险

和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

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

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

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

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

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

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

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

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

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

5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- a) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
  - b) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
  - c) 有关比例限制的执行情况。
  - d) 信息披露情况。
- 6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6、基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助乙方的监督和核查。基金因投资中小企业私募债券导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

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

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

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

11、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻

绕对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人 对基金托管人的业务核查

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

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

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

### （四）基金财产的保管

#### （A）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2. 基金托管人应安全保管基金财产。

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

5. 基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### （B）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名方式开立的证券账户下，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

2. 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、股票解冻等事宜。

### （C）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。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、支付或收取现金差额、支付或收取现金替代、支付或收取现金替代退补款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

### （D）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

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

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

(E) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

(F) 其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

(G) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

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

(H) 与基金财产有关的重大合同的保管

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

(五) 基金资产净值计算和会计核算

(A) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

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

## 2. 复核程序

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

3. 根据有关法律法规，基金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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (B) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1. 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

#### 2. 估值方法

##### a、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

##### b、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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



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

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

d、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

e、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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

f、中小企业私募债，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。

g、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

h、在任何情况下，基金管理人采用上述 a-g 项规定的方法对基金资产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为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。

i、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。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 h 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (C) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；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；错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回对价等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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份额净值计算错误，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。

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

（5）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（D）暂停估值与暂停公告基金份额净值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力或其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；

（3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

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

（5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（E）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （F）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （G）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。基金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。（2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（H）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的姓名或名称、持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记结算机构编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

#### （七）争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的修改与终止

##### （A）托管协议的变更程序

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

##### （B）基金托管协议终止出现的情形

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

##### （C）基金财产的清算

###### 1. 基金财产清算组

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

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

(3) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

###### 2. 基金财产清算程序

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

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；

- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

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

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、对基金份额持有人服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。

以下是基金管理人提供的主要服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

### （一）产品讯息咨询服务

投资者如果想查询基金净值、相关公告、基金产品与服务等信息，可通过拨打基金管理人客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，或登录本基金管理人网站（[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)）进行咨询、查询。

### （二）客户投诉与建议受理服务

客户对我们工作的意见和建议，可通过客服热线、留言信箱、电子邮件或信函等方式向我们提出，对于普通投诉我们会在两天内予以回复，对于重大投诉的回复不超过 72 小时。

## 二十六、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过指定报刊和指定网站（含基金管理人网站）公开披露。

序号	临时报告名称	披露时间
1	关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	2020 年 9 月 28 日
2	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	2020 年 10 月 9 日
3	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	2020 年 12 月 25 日
4	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	2021 年 3 月 18 日
5	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分指数基金基金合同等法律文件的公告	2021 年 3 月 31 日
6	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	2021 年 4 月 21 日
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2021 年 5 月 29 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2021 年 7 月 23 日

## 二十七、招募说明书存放及查阅方式

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



## 二十八、备查文件

- 1、中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

嘉实基金管理有限公司  
2022 年 09 月 17 日