

---

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)  
托管协议

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 目 录

一、托管协议当事人.....	2
二、托管协议的依据、目的、原则和解释.....	3
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查.....	3
四、基金管理人对于基金托管人的业务核查.....	6
五、基金财产的保管.....	6
六、指令的发送、确认及执行.....	8
七、交易及清算交收安排.....	9
八、基金资产净值计算和会计核算.....	11
九、基金收益分配.....	13
十、基金信息披露.....	14
十一、基金费用.....	16
十二、基金份额持有人名册的保管.....	17
十三、基金有关文件档案的保存.....	17
十四、基金托管人和基金管理人的更换.....	17
十五、禁止行为.....	18
十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算.....	18
十七、违约责任和责任划分.....	19
十八、适用法律与争议解决方式.....	21
十九、托管协议的效力.....	21
二十、托管协议的签订.....	21

鉴于华夏基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；

鉴于交通银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；

鉴于华夏基金管理有限公司为华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的基金管理人，交通银行股份有限公司为华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的基金托管人；

为明确华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

## 一、托管协议当事人

### (一)基金管理人(或简称“管理人”)

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

设立日期：1998年4月9日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38亿元人民币

存续期限：100年

联系电话：400-818-6666

### (二)基金托管人(或简称“托管人”)

名称：交通银行股份有限公司(简称：交通银行)

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

邮政编码：200120

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号

注册资本：742.63亿元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、托管协议的依据、目的、原则和解释

### (一)依据

本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》”)及其他有关法律法规与《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。

### (二)目的

订立本协议的目的是明确华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金托管人和华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

### (三)原则

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

### (四)解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《基金合同》的相应术语具有相同含义。

## 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金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、对象以及证券选择标准为：

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票(含存托凭证)、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后，本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。

其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 20%~95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0~80%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

根据基金合同规定，资产核心部分的投资不低于股票资产的 80%，因此，基金管理人应向基金托

管人提供核心股票池明细，当基金管理人需对核心股票池进行更新时，应提前 2 个工作日通知基金托管人。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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

1. 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
2. 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；
3. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
4. 本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；
5. 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
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%；
8. 本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
9. 本基金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%；
10. 现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；
11. 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；
12. 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
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本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
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境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

16.法律法规、《基金合同》规定的其他限制。

基金管理人应当自集中申购期结束后 1 个月内使本基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。除第 10、13、14 项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本协议第十五条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及时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。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。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进行更新，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，应以书面方式向基金托管人说明理由，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，并承担交易对手不履行合同造成的损失，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。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、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。

(六)基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，加强对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面的复核和监督。

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

(七)基金托管人发现基金管理人的上述事项及实际投资运作中违反法律法规和《基金合同》的规定，应及时以书面形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。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以电话或书面形式向基金托管人确认，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。

(八)对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九)基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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。

#### 四、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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

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

#### 五、基金财产的保管

##### (一)基金财产保管的原则

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

3.基金托管人按照规定开设基金财产的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.对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

6.除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委

托第三人托管基金财产。

## (二)基金银行账户的变更和管理

1.基金托管人应负责本基金的银行账户的变更和管理。

2.基金托管人以本基金的名义变更基金银行账户的资料。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

3.本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其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4.基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

5.基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

## (三)基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

## (四)基金证券账户和资金账户的变更和管理

1.基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司变更基金证券账户的资料。

2.本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

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

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



#### (五)债券托管专户的变更和管理

《基金合同》生效后,基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司变更基金银行间债券市场债券托管账户的资料,并向中国人民银行报备。

#### (六)基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库,但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。基金托管人对由基金托管人以外机构实际控制的证券不承担保管责任。

#### (七)与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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

## 六、指令的发送、确认及执行

### (一)基金管理人对发送指令人员的书面授权

1.基金管理人应当事先向基金托管人发出书面通知(以下称“授权通知”),载明基金管理人有权发送指令的人员名单(以下称“指令发送人员”)及各个人员的权限范围。基金管理人应向基金托管人提供指令发送人员的人名印鉴的预留印鉴样本和签字样本。

2.基金管理人向基金托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署,若由授权代表签署,还应附上法定代表人的授权书。基金托管人在收到授权通知后以电话确认。

3.基金管理人和基金托管人对授权通知及其更改负有保密义务,其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

### (二)指令的内容

指令是基金管理人在运作基金财产时,向基金托管人发出的资金划拨及投资指令。相关登记结算公司向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管人发出的指令。

### (三)指令的发送、确认和执行

1.指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表基金管理人用加密传真的方式或其他双方确认的方式向基金托管人发送,并通过电话与基金托管人确认指令内容。对于指令发送人员发出的指令,基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权,并且基金托管人已收到该通知,则对于此后该指令发送人员无权发送的指令,或超权限发送的指令,基金管理人不得

承担责任。

2.基金管理人应按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，基金管理人应及时电话通知基金托管人。

3.基金托管人在接受指令时，应对投资指令的要素是否齐全、印鉴是否与被授权人预留的授权文件内容相符等进行表面真实性的检查，并根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》等有关法律法规的规定对指令的内容合规性进行检查。对合法合规的指令，基金托管人应在规定期限内执行，不得延误。

4.基金管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单经有权人员签字并加盖公章后及时传真给基金托管人。

5.基金管理人在发送指令时，应为基金托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。指令传输不及时未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由基金管理人承担。

6.基金托管人正确执行基金管理人的合法合规指令而产生的相关法律责任，由基金管理人承担，基金托管人不承担该责任。基金托管人因未正确执行基金管理人的合法合规指令而使基金的利益受到损害或产生的相关法律责任，由基金托管人承担，基金管理人不承担该责任。

#### (四)基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。

#### (五)基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人的指令违法、违规的，不予执行，并及时书面通知基金管理人。基金托管人应依据有关法律法规的规定向中国证监会进行报告。

#### (六)被授权人员及授权权限的变更

基金管理人若对授权通知的内容进行修改(包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改)，应当至少提前 1 个工作日通知基金托管人；修改授权通知的文件应由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人授权通知的修改应当以加密传真的形式发送给基金托管人，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到变更通知后应向基金管理人电话确认。基金管理人授权通知的内容的修改自通知送达基金托管人之时起生效。基金管理人在此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交基金托管人。

## 七、交易及清算交收安排

(一)基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构。

### 1.选择代理证券买卖的证券经营机构的标准:

(1)资金雄厚, 信誉良好。

(2)财务状况良好, 经营行为规范, 最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。

(3)内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足本基金运作高度保密的要求。

(4)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理基金进行证券交易的需要, 并能为基金提供全面的信息服务。

(5)研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

### 2.选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议, 并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将委托协议(或席位租用协议)的原件及时送交基金托管人。

### 3.相关信息的通知

基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金专用席位的号码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况, 其中席位租用应至少在首次进行交易的 10 个工作日内通知基金托管人, 席位退租应在次日内通知到基金托管人。

## (二)基金清算交收

1.因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割, 由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。

2.由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的, 由过错方承担相应的责任。基金管理人同意在发生以上情形时, 基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

3.由于基金管理人或基金托管人原因导致基金无法按时支付清算款时, 过错方应对由此给基金财产造成的损失承担相应的赔偿责任。

4.基金管理人应保证在交收日(T+1 日)10: 00 前基金银行账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算, 如基金的资金头寸不足则基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

5.基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时, 基金银行账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时, 基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令, 由

此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间。在基金资金头寸充足的情况下，基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。

6.每个工作日 17:00 后收到的，通过中国人民银行小额支付系统汇划给本基金的应收款项，于下一个工作日进行会计账务处理。

### (三)资金、证券账目和交易记录核对

基金管理人和基金托管人应对本基金的资金、证券账目及交易记录进行核对。

### (四)申购、赎回的资金清算

1.T 日，投资者提交申购、赎回申请，基金管理人和基金托管人分别计算基金资产净值，并进行核对；基金管理人将双方盖章确认的或基金管理人决定采用的基金份额净值以基金份额净值公告的形式传真至相关信息披露媒介。

2.T+1 日，登记结算机构根据 T 日基金份额净值计算申购份额、赎回金额，更新基金份额持有人数据库；并将确认的申购、赎回数据向基金托管人、基金管理人传送。基金管理人、基金托管人根据确认数据进行账务处理。

3.基金管理人、基金托管人以及各代销机构应按照登记结算机构(即中国证券登记结算有限责任公司)要求开立“结算备付金账户”，用于办理基金申购、赎回款项的清算交收。基金托管账户与“结算备付金账户”间的资金清算遵循“多边净额结算”的原则。

4.有关本基金申购资金到账和赎回资金划出的具体时间和办理程序，按照《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》的规定执行。

## 八、基金资产净值计算和会计核算

### (一)基金资产净值的计算和复核

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日各类基金资产净值除以计算日该类基金份额总数后的价值。

2.基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5.当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

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

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

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

## (二)基金会计核算

### 1.基金账册的建立

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

### 2.会计数据和财务指标的核对

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

### 3.基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在3个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上。基金招募说明书的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书。。季度报告应在季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于季度结束之日起15个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于上半年结束之日起2个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于每年结束之日起3个月内予以公告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后20日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后30日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

#### (三)实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

(四)对于相关信息的发送与复核，基金管理人和基金托管人也可以采用法律法规规定或者双方认可的其他方式进行。

## 九、基金收益分配

### (一)基金收益分配的依据

1.基金收益分配是指将该基金的净收益根据持有该基金份额的数量按比例向该基金份额持有人

进行分配。基金净收益是该基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中提取的有关费用等项目后得出的余额。

2.收益分配应该符合《基金合同》关于收益分配原则的规定。

#### (二)基金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根据《基金合同》的相关规定制定。

2.基金管理人应于收益分配日之前将其制定的收益分配方案提交基金托管人审核，基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的审核，并将审核意见书面通知基金管理人，审核通过后基金管理人应当将收益分配方案对外予以公告；如果基金管理人与基金托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致，基金托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明提交中国证监会备案并书面通知基金管理人，在上述文件提交完毕之日起基金管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案，且基金托管人有义务协助基金管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及《基金合同》的除外。

3.基金收益分配可采用现金红利的方式，或者将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资的方式(下称“再投资方式”)，投资者可以选择两种方式中的一种；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金红利的方式处理。

4.基金托管人根据基金管理人的收益分配方案和提供的现金红利金额的数据，在红利发放日将分红资金划出。如果投资者选择转购基金份额，基金管理人和基金托管人则应当进行红利再投资的账务处理。

#### (三) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 十、基金信息披露

### (一)保密义务

1.除按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定外，基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应予保密。基金管理人与基金托管人对本基金的任何信息，不得在其公开披露之前，先行对双方和基金份额持有人大会以外的任何机构、组织和个人泄露。法律法规另有规定的以及各方专门聘请的会计师事务所、法律顾问的情况除外。

2.基金管理人和基金托管人除为合法履行法律法规、《基金合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的基金的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述

义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：

(1)非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

(2)基金管理人和基金托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。

(二)基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1.基金管理人和基金托管人应根据相关法律法规、《基金合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。基金管理人和基金托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

2.本基金信息披露的所有文件，包括《基金合同》和本协议规定的定期报告、临时报告、基金净值信息、实施侧袋机制期间的信息披露及其他必要的公告文件，由基金管理人和基金托管人按照有关法律法规的规定予以公布。

3.基金年度报告中的财务会计报告必须经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计。

4.本基金的信息披露应通过中国证监会指定媒介进行；基金管理人、基金托管人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，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

5.信息文本的存放与备查

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，以供社会公众查阅、复制。

6.对于因不可抗力等原因导致基金信息的暂停或延迟披露的(如暂停披露基金净值信息)，基金管理人应及时向中国证监会报告，并与基金托管人协商采取补救措施。不可抗力情形消失后，基金管理人和基金托管人应及时恢复办理信息披露。

(三)基金托管人报告

基金托管人应按《基金法》、《运作办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和其他有关法律法规的规定于每个上半年度结束后 50 日内、每个会计年度结束后 80 日内在基金中期报告及年度报告中分别出具托管人报告。

(四)实施侧袋机制期间的信息披露

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

(五)法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。



## 十一、基金费用

### (一)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月首日起 15 个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并做出划付指令；基金托管人应在次月首日起 15 个工作日内完成复核，并从该基金财产中一次性支付管理费给该基金管理人。

### (二)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，基金管理人应于次月首日起 15 个工作日内将上月基金托管费的计算结果通知基金托管人并做出划付指令；基金托管人应在次月首日起 15 个工作日内完成复核，并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

### (三) 基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.50%。基金销售服务费计提的计算公式具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### (四)实施侧袋机制期间的基金费用

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

(五)基金管理人或基金托管人可酌情调低该基金管理费和/或托管费。

(六)从基金财产中列支基金管理人的管理费、基金托管人的托管费、销售服务费之外的其他基金费用，应当依据有关法律法规、《基金合同》的规定。

(七)对于违反《基金法》、《基金合同》、《运作办法》及其他有关规定的基金费用(包括基金费用的计提方法、计提标准、支付方式等)，不得从任何基金财产中列支。

## 十二、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金管理人可委托登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1.基金管理人应于基金合同生效日及基金合同终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

2.基金管理人应于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

3.基金管理人应于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

4.除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册。

基金管理人和基金托管人应按照相关法律法规分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

## 十三、基金有关文件档案的保存

(一)基金管理人应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，基金托管人应保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限为 15 年。

(二)基金管理人和基金托管人应按本协议第十条的约定对各自保存的文件和档案履行保密义务。

## 十四、基金托管人和基金管理人的更换

(一)基金管理人职责终止后，仍应妥善保管基金管理业务资料，并与新任基金管理人或临时基金管理人及时办理基金管理业务的移交手续。基金托管人应给予积极配合，并与新任基金管理人或临时

基金管理人核对基金资产总值和净值。

(二)基金托管人职责终止后, 仍应妥善保管基金财产和基金托管业务资料, 并与新任基金托管人或临时基金托管人及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续。基金管理人应给予积极配合, 并与新任基金托管人或临时基金托管人核对基金资产总值和净值。

(三)其他事宜见《基金合同》的相关约定。

## 十五、禁止行为

(一)《基金法》第二十条、第三十一条禁止的行为。

(二)《基金法》第五十九条禁止的投资或活动。

(三)除根据基金管理人的指令或《基金合同》、本协议另有规定外, 基金托管人不得动用或处分基金财产。

(四)基金管理人、基金托管人的高级管理人员和其他从业人员不得相互兼职。

(五)法律法规、《基金合同》和本协议禁止的其他行为。

## 十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

(一)托管协议的变更

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

(二)托管协议的终止

发生以下情况, 本托管协议终止:

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

(三)基金财产的清算

1. 基金财产清算组

(1)在基金财产清算组接管基金财产之前, 基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

(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。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.清算程序

- (1)《基金合同》终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行评估和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)请会计师事务所对清算报告进行审计，请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7)对基金财产进行分配。

## 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.基金剩余财产的分配

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)、(2)、(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

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在 2 个工作日内公告。

## 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。

## 十七、违约责任和责任划分

(一)本协议当事人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

(二)因本协议当事人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

(三)一方当事人违反本协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任。

(四)发生下列情况时，违约方可以免责：

1.不可抗力；

2.基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3.基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则投资或不投资造成的损失或潜在损失等。

(五)当事人一方违约，另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。

(六)违约行为虽已发生，但本协议能够继续履行的，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。

(七)为明确责任，在不影响本协议本条其他规定的普遍适用性的前提下，基金管理人和基金托管人对由于如下行为造成的损失的责任承担问题，明确如下：

1.由于下达违法、违规的指令所导致的责任，由基金管理人承担；

2.指令下达人员在授权通知载明的权限范围内下达的指令所导致的责任，由基金管理人承担，即使该人员下达指令并没有获得基金管理人的实际授权(例如基金管理人在撤销或变更授权权限后未能及时通知基金托管人)；但如果基金托管人明知或应当知道指令下达人员所下达的指令未获得授权或超越权限，则责任应由基金托管人承担；

3.基金托管人未对指令上签名和印鉴与预留签字样本和预留印鉴进行表面真实性审核，导致基金托管人执行了应当无效的指令，由此产生的责任应由该基金托管人承担；

4.基金财产(包括实物证券)在基金托管人保管(包括委托他人保管)期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由该基金托管人承担；

5.基金管理人应承担制定错误的基金收益分配方案所产生的责任，如果基金托管人经复核同意该分配方案，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；

6.基金管理人应承担对其应收取的管理费数额计算错误的责任，如果基金托管人复核后同意基金管理人的计算结果，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；

7.基金管理人应承担对基金托管人应收取的托管费数额计算错误的责任，如果基金托管人复核后同意基金管理人的计算结果，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；

8.由于基金管理人或托管人原因导致本基金不能依据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则及时清算的，由过错方承担由此产生的不利后果；

9.在资金交收日，基金资金账户资金首先用于除新股申购以外的其他资金交收义务，交收完成后资金余额方可用于新股申购。如果因此资金不足造成新股申购失败或者新股申购不足，基金托管人不承担任何责任。如基金份额持有人因此提出赔偿要求，相关法律责任和损失由基金管理人承担。

本协议所述责任划分仅指基金/基金管理人、基金/基金托管人之间的责任划分，并不影响承担任一方向其他责任方追索的权利。

## 十八、适用法律与争议解决方式

(一)本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二)基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三)除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## 十九、托管协议的效力

(一)本协议由《兴科证券投资基金托管协议》修订而成。本协议经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权代表签字，报中国证监会核准后，自兴科基金终止上市之日起生效，原《兴科证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

(二)本协议的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三)本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。

(四)本协议正本一式 6 份，协议双方各执 2 份，上报中国证监会和中国银保监会各 1 份，每份具有同等法律效力。

## 二十、托管协议的签订

见签署页。

(以下无正文)