

嘉实黄金证券投资基金（LOF）

更新招募说明书

（2026年08月22日更新）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

嘉实黄金证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）根据 2011 年 5 月 31 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可〔2011〕839 号）和 2011 年 6 月 15 日《关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集时间安排的确认函》（基金部函〔2011〕376 号）核准进行募集。本基金类型为上市契约型开放式。本基金基金合同于 2011 年 8 月 4 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《嘉实黄金证券投资基金（LOF）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。

本基金属于基金中的基金，在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的 80%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的 80%，因此，本基金投资于有实物黄金支持的公募基金的比例可低至 64%。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请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：黄金价格下跌的风险：黄金价格走势是影响本基金业绩表现的最重要的因素，黄金价格下跌将导致黄金 ETF 净值下跌；跟踪误差和累计偏离度不能正确反映基金跟踪效果的风险：由于国际黄金报价的连续性及其我国 QDII 特定估值方法等原因，投资者以本基金的基金净值计算的跟踪误

差和累计偏离度可能不能正确反映其跟踪效果；海外投资面临的国别地区市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、流动性风险、汇率风险、利率风险；衍生品风险：为回避汇率风险和有效管理，本基金有可能投资衍生工具，从而引发的风险；等等。本基金主要投资于黄金基金，并不代表本基金可以保本或保证收益，基金投资仍有可能出现亏损。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金于 2012 年 2 月 10 日在深圳证券交易所上市交易。在上市交易期间，如继续接受申购可能导致本基金突破国家外汇局批准的外汇额度，本基金将暂停申购，由此可能导致二级市场价格出现较大波动。当本基金因外汇额度原因暂停申购期间出现了较高的折溢价率，折溢价率可能因国家外汇局批准基金管理人新增外汇额度以及本基金恢复申购业务而大幅缩小，亦可能导致本基金二级市场价格出现较大波动。本基金二级市场收盘价折溢价率可能因黄金价格波动等市场因素发生较大变动。

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。

投资有风险，投资者申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2026 年 7 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日（未经审计），特别事项注明除外。

目录

一、绪言	4
二、释义	5
三、风险提示	12
四、基金的投资	18
五、基金的业绩	37
六、基金管理人	39
七、基金的募集	49
八、基金合同的生效	52
九、基金份额的上市交易	53
十、基金份额的申购、赎回	55
十一、基金的费用与税收	67
十二、基金的财产	69
十三、基金资产的估值	71
十四、基金的收益分配	76
十五、基金的会计和审计	78
十六、基金的信息披露	79
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	84
十八、基金托管人	87
十九、境外托管人	91
二十、相关服务机构	92
二十一、基金合同的内容摘要	130
二十二、基金托管协议的内容摘要	149
二十三、对基金份额持有人的服务	164
二十四、其他应披露事项	166
二十五、招募说明书存放及查阅方式	168
二十六、备查文件	169

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》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称《通知》）和其他相关法律法规的规定以及《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《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。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	指嘉实黄金证券投资基金（LOF）
《招募说明书》	指《嘉实黄金证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
《基金合同》	指《嘉实黄金证券投资基金基金（LOF）合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
《托管协议》	指基金管理人与基金托管人签订的《嘉实黄金证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充
《发售公告》	指《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
上市交易公告书	指《嘉实黄金证券投资基金基金份额上市交易公告书》
基金产品资料概要	指《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新
《业务规则》	指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《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》及非直销销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则
中国	指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《流动性风险管理规定》	指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
《试行办法》	指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》
《通知》	《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》
元	指中国法定货币人民币元
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构
外管局	指国家外汇管理局或其授权的代表机构
基金管理人	指嘉实基金管理有限公司
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司
境外托管人	指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
基金份额持有人	指根据《招募说明书》和《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金非直销销售机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及基金非直销销售机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金非直销销

	售机构的销售网点
注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指嘉实基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	指自基金份额发售之日起不超过3个月的期限
基金存续期	指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

开放日	指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	指《基金合同》生效后，投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。
赎回	指《基金合同》生效后，基金份额持有人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。
巨额赎回	指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
上市交易	指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
基金销售	指对基金申购、赎回、转换等业务（不包括交易）的统称
场内	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所

场外	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
证券账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在基金注册登记机构的证券登记结算系统
开放式基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
投资指令	指基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令
基金转换	指投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金注册登记系统	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，又简称为TA系统
证券登记结算系统	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
场外份额	登记在注册登记系统下的基金份额场内份额，登记在证券登记结算系统下的基金份额

系统内转托管	指投资者将托管在某场内非直销销售机构（或营业网点）的基金份额转托管到其他场内非直销销售机构（或其他营业网点），或将托管在基金管理人或某场外非直销销售机构的基金份额转托管到其他场外非直销销售机构或基金管理人的行为
跨系统转托管	指投资者将托管在某场内非直销销售机构的基金份额转托管到基金管理人或某场外非直销销售机构，或将托管在基金管理人或某场外非直销销售机构的基金份额转托管到某场内非直销销售机构的行为
基金收益	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额
基金资产总值	指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后得出的单位基金份额的价值
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的过程
货币市场工具	指银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的金融工具
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
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件或因素，包括但不限于洪

	水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等
黄金 ETF	指黄金交易型开放式基金（Gold Exchange Traded Fund，简称“黄金 ETF”），是一种以实物黄金或者实物黄金收益凭证为基础资产，以追踪黄金现货价格波动为目标，并在证券交易所上市交易的交易所交易基金
黄金基金	指黄金 ETF、黄金股票指数 ETF 以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金
与中国证监会签订了双边 监管合作谅解备忘录的国家和地区	截至 2015 年 6 月共有以下国家和地区，包括美国、中国香港、新加坡、澳大利亚、英国、日本、马来西亚、巴西、法国、德国、意大利、埃及、韩国、罗马尼亚、南非共和国、荷兰、比利时、加拿大、瑞士联邦、印度尼西亚、新西兰、葡萄牙、尼日利亚、越南、阿根廷、约旦、挪威、土耳其、印度、阿联酋、泰国、列支敦士、蒙古、俄罗斯、迪拜、爱尔兰、奥地利、西班牙、中国台湾、马耳他、科威特、巴基斯坦、以色列、卡塔尔、老挝、瑞典、卢森堡、塞浦路斯、乌克兰、立陶宛、白俄罗斯、文莱、耿西、泽西岛、马恩岛、波兰、哈萨克斯坦、阿塞拜疆

三、风险提示

本基金属于基金中的基金，在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的80%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的80%，因此，本基金投资于有实物黄金支持的公募基金的比例可低至64%。投资者投资本基金可能面临的风险包括：一是本基金特有风险，包括基金业绩严重受黄金价格单一因素影响、投资黄金ETF所面临的特有风险、投资对象资产数量与资产规模有限引致的特殊风险等；二是全球投资风险，包括海外市场风险、国家风险和政府管制风险、汇率与外汇管制风险、政治和法律风险、会计核算风险、税务风险等；三是本基金投资风险，包括投资标的的风险、利率风险、衍生品风险、信用风险、流动性风险、交易结算风险、金融模型风险等；四是管理风险、操作和技术风险以及不可抗力风险等其它风险。本基金属于具有较高风险和较高收益预期的证券投资基金品种，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。

（一） 本基金特有风险

1、基金业绩严重受黄金价格单一因素的影响

本基金主要投资于境外市场黄金ETF，本基金业绩表现受黄金价格波动影响较大。影响黄金价格波动的因素包括但不限于：

- （1） 全球黄金供给和需求的变动。包括因为黄金生产商的对冲、各国央行的购买和出售、主要黄金生产国黄金生产成本的变动等；
- （2） 投资者对通胀水平的预期；
- （3） 主要经济体的利率水平；
- （4） 主要经济体法定货币币值的变动；
- （5） 各国央行、对冲基金、商品基金等机构投资者的投资与交易活动；
- （6） 全球或地区政治、经济、金融局势及货币体系的变化。

黄金价格波动具有长周期的特点，其预期收益可能在较长的期限内超越股票、债券等传统资产类别，也可能在较长期限内持续缺乏吸引力。黄金价格的长周期波动构成本基金最大的风险之一。

2、投资黄金ETF等黄金交易所交易产品所面临的特有风险

（1） 黄金ETF大多追踪伦敦黄金市场定盘价，黄金价格的波动将体现在黄金ETF的基金资产净值中。黄金价格的下跌将对基金资产形成不利影响。

（2） 黄金ETF的市场价格受到二级市场供求关系的影响，价格可能与资产份额净值出现折价或溢价，因此面临流动性风险。

（3）为维持黄金ETF的运作，基金资产需承担一定费用，反映在黄金ETF的价格和份额净值中，体现为黄金ETF的业绩表现落后于黄金价格涨幅。因此，本基金投资黄金ETF的收益会与黄金价格走势出现偏离。

（4）黄金ETF所持有的实物黄金可能存在盗窃、损坏等风险，也可能因为实物黄金的品质低于市场标准，或资产托管人（此处特指黄金ETF的资产托管人）未能及时将申购的黄金由非指定账户转至基金指定账户，导致黄金ETF的资产产生损失。如出现上述情形，基金资产将受到不利影响。

（5）为尽可能减少因为管理费等带来的跟踪误差，或者因为市场条件发生变化有实物黄金支持的黄金ETF等黄金基金在数量、规模、和流动性等方面无法支持本基金的正常投资运作，本基金有可能通过投资以黄金ETF等黄金基金为标的资产的衍生工具、非实物黄金支持的交易所交易基金或其他追踪黄金价格的非上市公募基金。此类投资产品与其跟踪标的的表现可能不一致，并可能存在对手方信用风险，从而影响本基金的业绩表现。

（6）由于国际黄金价格实行24小时连续报价的特殊性，海外黄金ETF等交易所交易产品的二级市场收盘价可能由于交易时差等原因与标的资产价格产生较大的偏离。因此海外黄金ETF等交易所交易产品在跟踪误差的计算方法（以NAV计算）与我国QDII现行规则（以二级市场收盘价计算）存在较大差别，投资者以本基金的基金净值计算的跟踪误差和累计偏离度可能由于上述原因不能正确反映其跟踪效果。

（7）本基金主要通过投资于海外黄金ETF等黄金基金实现对国际黄金价格的跟踪。在实际操作过程中，如果黄金ETF等境外投资标的由于费用变更、估值方法变更、业绩比较基准计算方法变更、或者其他不可抗力，本基金投资收益与黄金价格走势之间的跟踪误差或者累计偏离度可能因为上述原因发生变化。

3、投资对象资产数量与资产规模有限引致的特殊风险

由于有实物黄金支持的黄金ETF等交易所交易产品数量和资产规模有限，本基金必须根据法律法规的要求进行分散投资，影响了投资的灵活性。例如，当流动性最强、跟踪偏离度最低的黄金ETF投资比例已达到合规性上限时，本基金必须寻找次优的投资目标，从而影响本基金的投资表现。

另外，如果黄金ETF的规模大幅缩小，本基金对该黄金ETF的投资可能会被动超标，而被迫减持该基金，带来额外的交易成本，对基金资产净值形成负面影响。

4、上市交易及外汇额度限制引致的特殊风险

（1）基金合同生效六个月后，在相关条件成熟的情况下，本基金管理人将向深圳证券交易所申请上市交易，即本基金在合同生效的六个月内不会上市交易。届时投资者仅可通过赎回基金份额进行变现。

（2）在上市交易期间，如继续接受申购可能导致突破国家外汇局批准的外汇额度，本基金将暂停申购，由此可能导致二级市场价格出现较大波动。

（3）当本基金因外汇额度原因暂停申购期间出现了较高的折溢价率，折溢价率可能因国家外汇局批准基金管理人新增外汇额度以及本基金恢复申购业务而大幅缩小，亦可能导致本基金二级市场价格出现较大波动。

（4）本基金二级市场收盘价折溢价率可能因黄金价格波动等市场因素发生较大变动。

（二）全球投资风险

1 海外市场风险

由于本基金投资于海外证券市场，各国或地区处于不同产业景气循环周期位置，将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场可能对于特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反应较境内证券市场有诸多不同。并且拟投资市场如美国、新加坡、香港的证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间可能相对较大。以上所述因素可能带来市场的急剧波动，从而带来投资风险的增加。

2 国家风险和政府管制风险

本基金投资于全球不同国家的市场，各国对市场的管制程度和具体措施不同，可能通过该国该地区的财政、货币、产业等方面的政策进行管制，由此导致市场波动而影响基金收益。

3 政治风险

基金所投资的国家/地区因政治局势变化(如罢工、暴动、战争等)或法令的变动,可能导致市场的较大波动,从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。此外,基金所投资的国家/地区可能会不时采取某些管制措施,如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化以及征收高额税收等,从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

4 汇率与外汇管制风险

本基金以人民币募集和计价,经过换汇后投资于全球市场以多种外币计价的金融工具。外币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值,从而导致基金资产面临潜在风险。此外,本基金可投资于全球成熟市场和新兴市场,部分新兴市场国家/地区可能对外汇实施管制,从而带来一定的货币汇兑风险。

5 会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误。由于各个国家/地区对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定存在一定差异,可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差,从而给本基金投资带来潜在风险。同时基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中,可能由于客观原因与非主观故意造成行为过失,从而对基金收益造成影响。

6 税收风险

在投资各国或地区市场时,因各国、地区税务法律法规的不同,可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金,包括预扣税,该行为可能会使得资产回报

受到一定影响。此外,各个国家/地区的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致基金向该国家/地区缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

（三）基金投资风险

1 投资标的风险

本基金主要投资于黄金ETF,该类金融产品的目标是追踪黄金价格的走势,金价走势无疑是投资黄金ETF最大的风险因素。当然,作为一种基于实物黄金的金融工具,因其交易制度、组织架构等也会带来一些特有的风险,包括:二级市场交易价格偏离净值风险、基金发行导致金价上涨的风险、黄金保管风险等。

（1）黄金ETF基金份额的净值受黄金波动影响巨大

黄金ETF的目标是尽量反映黄金价格表现,而黄金ETF净值与其所持有的黄金价值有直接关联。过去数年,黄金价格存在着一定的波动性。

（2）基金份额在二级市场交易可能偏离其净值

ETF份额可以等于、高于或低于基金份额净值的价格买卖。基金份额净值随黄金ETF资产市值的波动而波动。基金份额交易价格随基金份额净值的变动及市场供求而波动。交易价格较基金份额净值的折价或溢价金额可能会因商品交易所和证券交易所时间不一致等因素而受影响。

（3）基金发行过程本身带来的影响

黄金ETF以黄金为基础资产,有多少基金份额被发行在外,就意味着有多少黄金金条被收入基金在保管人处开立的账户中。在基金发行初期,授权会员为申购基金,必须大量买入黄金并存入保管人处,这无疑将提振对黄金现货的需求,造成短期内金价上涨。当基金发行完毕,市场需求大量下降,金价和基金份额的净值可能马上下跌。

（4）黄金保管风险

黄金ETF持有的黄金资产可能遭遇丢失、损坏或偷盗的风险。黄金ETF的托管人并不对黄金进行保险,保管人仅对其保管黄金的业务实力情况进行适度保险,而且,托管人也不是保险合约的受益人。因此,若以上黄金损失真的发生,保管人可能得不到足够的保险保障。

2 流动性风险

市场流动性风险是指由于市场深度不够或者其他原因,导致投资机构不能在不影响市场价格的情况下买入或卖出证券。由于开放式基金的特殊要求,本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的要求。由于全球证券市场波动性较大,在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况,如果在这时出现较大数额赎回申请,则基金资产仓位调整和/或变现困难,或成本很高,基金面临流动性风险,可能影响基金份额净值。同时,由于本基金涉及跨境交易,其赎回到帐期通常需要比现有开放式基金更长的时间。

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，本基金申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及纽约证券交易所、伦敦证券交易所、苏黎世证券交易所同时开放交易的每个工作日，但基金管理人根据法律法规根据法律法规、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。场内申购、赎回业务办理时间为9:30-11:30和13:00-15:00；场外申购、赎回业务开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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

本基金主要投资于全球证券市场上依法可投资的公募基金（包括ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金将选取流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、透明度较高、费率低廉、估值基准与本基金的业绩基准间的差异小、组织架构合理的黄金ETF作为主要投资对象，构建备选基金库。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可能采用以下流动性风险管理措施，以控制因巨额赎回可能产生的流动性风险：

（1）部分延期赎回，并对当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额30%的单个赎回申请人部分延期办理；

（2）暂停赎回；

（3）中国证监会认定的其他措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

（1）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款项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。

（2）若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分

“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（3）本基金对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资者赎回基金份额时收取。

3 衍生品风险

衍生品所特有的风险在于增加组合的杠杆率，放大收益或损失，例如，支付少量保证金或期权费可以获得大量的期货或期权所代表的基础资产的风险敞口，尤其在市场面临突发事件时，可能会导致投资亏损高于初始投资金额，从而对基金收益带来不利影响。此外，衍生品的交易可能不够活跃，在市场变化时，可能因无法及时找到交易对手或交易对手方压低报价，导致基金资产的额外损失。

4 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平，企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

5 信用风险

信用风险是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，都可能导致基金资产损失和收益变化。一般认为：国债的信用风险较低，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级的变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。。通常来讲，低信用级别机构所发行的债券会提供高于其他优质信用级别债券的回报，但也会伴随着更大的损失的风险。本基金所面临的主要来自于银行存款等货币市场金融工具。

6 大宗交易风险

大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

7 金融模型风险

本基金所用的金融模型是建立在金融理论，数据统计和计算程序上的。其中任何一个环节的微小问题，都有可能导导致模型的结果偏差。模型风险主要来源于：理论模型不够完善，模型参数调整不当，欠缺足够的软硬件网络计算能力以及统计分析得到的数据关系不够稳定。我们通过以下措施用以降低模型风险，提高模型的精确性和有效性。（1）基础模型必须建立在完善的金融理论与推导之上；（2）模型需要有专业人员进行调试、维护和评价；（3）统计模型必须通过严谨的统计置信度检验；（4）在有同类商用模型的情况下，将选取具有代表性的债券品种集合用内部模型同外部第三方模型进行验证。在结果有较大差异时要找出其中原因。

8 证券借贷/正回购/逆回购风险

证券借贷/正回购/逆回购风险的主要风险在于交易对手风险，具体讲，对于证券借贷，交易期满时借方未如约偿还所借证券，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红；对于正回购，交易期满时买方未如约卖回已买入证券，或在交易期间未如约支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；对于逆回购，交易期满时卖方未如约买回已售出证券。

9 交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

（四）其他风险

1 管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。例如资产配置、类属配置因市场原因可能无法达到预期收益目标；也可能表现在个券的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

2 操作风险和技术风险

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原因可能引致风险，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人、基金托管人、境外资产托管人、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

3 大额赎回风险

本基金为开放式基金，基金规模将随着投资者对基金单位的赎回而不断变化，若是由于投资者的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

4 顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

5 不可抗力风险

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、代理机构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份额持有人利益受损。

四、基金的投资

（一） 投资目标

本基金主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。

（二） 投资理念

自古以来黄金作为一种特殊的资产类别，集贵金属属性、货币属性、和金融属性于一身，具有资产增值、保值避险、抵御通胀、风险分散等优点，但同时也存在投资门槛高、不易交割保管、缺乏流动性、难于变现等诸多不便。黄金 ETF 通过合理的运作机制，将实物黄金属性和证券属性巧妙结合，提供交易便捷、高流动性的黄金投资工具，是近年来国际市场上发展最迅速的金融创新产品之一。

本基金主要投资于境外黄金 ETF，特别是有实物黄金支持的黄金 ETF，并以上市开放式（LOF）形式在深圳证券交易所上市交易，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场金价走势的有效跟踪，为国内投资者提供参与国际黄金投资市场的有效投资工具。

（三） 投资范围

本基金主要投资于全球证券市场中依法可投资的公募基金（包括 ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金的投资组合比例范围：在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的 80%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。黄金基金指黄金 ETF、黄金股票指数 ETF 以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金 ETF 外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的 ETF，以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并

履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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

（四）投资策略

本基金主要通过投资于海外市场跟踪黄金价格的交易所交易基金（ETF）以实现黄金价格的有效跟踪，所投资的海外市场黄金 ETF 将以有实物黄金支持的金融工具为主。本基金不直接买卖或持有实物黄金。

本基金的具体投资策略包括 ETF 组合管理策略、现金管理策略以及衍生品投资策略三部分组成：

1、ETF 组合管理策略

（1）黄金 ETF 的选择标准

本基金目前将选择有实物黄金支持（backed by physical gold）的黄金 ETF 作为主要投资标的。实物黄金支持的黄金 ETF 基金管理人持有标准化实物黄金并且一级市场的申购赎回也是以实物黄金进行，从而此类黄金 ETF 可以有效跟踪黄金价格。

在具体遴选黄金 ETF 的过程中，本基金主要考虑的因素包括：资产规模（Asset under management）、跟踪误差（tracking error）、估值基准（basis of valuation）、计价货币（denominator）、流动性（liquidity）、透明度（transparency）、上市地（listing exchange）、ETF 管理公司（Management Company）、组织架构（structure）等。具体说明如下：

1）规模：是指黄金 ETF 本身所管理的资产规模大小，而有实物黄金支持的黄金 ETF 可以从市值规模和黄金储存量两个角度来衡量，规模越大，越可以产生规模效应，降低黄金 ETF 本身运营成本从而降低跟踪误差，并且增加投资安全性；

2）跟踪误差：是指黄金 ETF 的资产净值（NAV）与跟踪指数（一般为金价）的偏离度，跟踪误差越小，说明黄金 ETF 的运作越成功；

3）估值基准：是指黄金 ETF 每日进行估值的基准，目前绝大部分黄金 ETF 均以伦敦金的价格作为基准；

4）计价货币：是指黄金 ETF 每日估值和交易的基准货币，由于国际通用金价为美元计价，所以本基金将以美元计价的黄金 ETF 为主，以减小其它货币对美元的汇率风险；

5）流动性：是指黄金 ETF 在二级市场交易量的大小以及买卖价差的大小。本基金在二级市场买入黄金 ETF 基金份额时，标的 ETF 流动性高，产生的冲击成本会越小，越有利于本基金跟踪误差的控制；

6) 透明度：主要指黄金 ETF 的信息披露程度，信息披露越完全、真实、迅速，越可以减少潜在的投资风险；

8) 上市地：本基金投资于与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区的黄金 ETF；

9) ETF 管理公司：选择运作黄金 ETF 时间长，运作成熟，管理规模大的 ETF 管理公司，将有利于降低本基金的潜在对手方风险；

10) 组织架构：主要指黄金 ETF 各参与方的权责关系和合约结构，不同市场上黄金 ETF 的组织架构有所不同，合理的组织架构可以保障黄金 ETF 的顺利运作，减少潜在的参与方风险。

本基金将选取流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、透明度较高、费率低廉、估值基准与本基金的业绩基准间的差异小、组织架构合理的黄金 ETF 作为主要投资对象，构建备选基金库。

（2）组合构建策略

本基金在备选基金库的基础上，在建仓期内综合考虑备选基金库中黄金 ETF 的历史运作记录、市场流动性、上市交易所、交易币种等因素，并以最优跟踪本基金基准、从而使本基金跟踪误差最小为目标来进行黄金 ETF 投资组合的构建。

（3）组合调整策略

在投资组合构建完成后，本基金基本上将采用买入持有的投资策略，但本基金会根据 ETF 投资组合和现金比例严格控制基金净值和基准的偏差，适时调整组合内不同 ETF 的比重以及现金比例，以实现有效跟踪。

同时，由于本基金为开放式基金，我们还会根据申购赎回需求，灵活调整组合，结合现金管理策略，满足日常的申赎需求。

2、现金管理策略

现金管理是本基金投资管理的重要组成部分，根据现有法律法规的规定本基金所持有的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，而持有过多的现金资产势必因为现金拖累而本基金的跟踪效果产生影响，基金管理人将在满足现有法律法规和日常申购赎回所需流动性的前提下，合理制定持有现金资产的比例，有效地实现对业绩基准的跟踪。

同时，基金管理人也将满足现有法律法规的规定和基金流动性的前提下，尽可能提高现金资产的收益率。

3、衍生品投资策略

为降低留存现金、汇率因素的影响，本基金还将本着谨慎原则，在风险可控的前提下，投资于以黄金 ETF、黄金股票指数 ETF 等黄金基金为标的资产的期货与期权，以及外汇远期合约等汇率衍生品。

衍生品投资的主要策略包括：

1）规避汇率风险。本基金可利用外汇远期合约规避外币资产对人民币的汇率风险，避免汇率剧烈波动对基金的业绩产生不良影响等。

2）有效管理。主要包括对现金流量的有效管理、降低冲击成本等。在短期的申购赎回规模较大或市场大幅波动时，利用金融衍生品可迅速调整现金头寸，同时管理风险以减少不利影响。

（五）投资程序

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

（2）全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、各国微观经济运行环境、以及证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础；

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障；

（4）投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过投资团队的共同努力，由基金经理具体执行投资计划，争取良好投资业绩。

2、决策程序

2.1 ETF 的投资

本基金主要通过投资于有实物黄金支持的黄金 ETF 的方式达成跟踪金价的投资目标。本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金 ETF，基本上采取买入持有的投资策略，并根据投资组合的跟踪误差、流动性等因素定期进行调整和再平衡。具体而言，ETF 投资的决策程序与流程如下：

（1）投资原则的制定

投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下，根据研究人员和基金经理的有关报告，决定基金投资的主要原则，对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

（2）备选基金库筛选

本基金原则上选取发达市场交易所交易的黄金 ETF 品种，目前主要涉及的交易所有纽约、伦敦、苏黎世、多伦多、香港、悉尼等发达市场。本基金将选取流动性良好、规模合理、跟踪误差较小、透明度较高、费率低廉、挂牌时间较长、估值基准与本基金的业绩基准间的差异较小、组织架构合理的黄金 ETF 作为主要投资对象，构建备选基金库。

（3）组合构建

研究部和基金经理根据投资限制的要求,综合考虑备选基金库中黄金 ETF 的历史运作记录、市场流动性、上市交易所、交易币种等因素,在合法合规的前提下,利用最少数量的有实物黄金支持的黄金 ETF 构建本基金的模拟组合,进行跟踪误差和流动性检验,并在此基础上构建投资组合。

（4）组合调整

基金经理有权根据环境的变化和实际的需要,在其权限范围内对组合进行调整,超出其权限的调整,需报投资决策委员会审批。组合调整至少每季度一次,调整的标准主要是依据组合对于金价的跟踪误差,适当降低跟踪误差大的黄金 ETF 比重、增加跟踪误差小的黄金 ETF 比重,或者是调出跟踪误差大的黄金 ETF、调入跟踪误差小的黄金 ETF。

2.2 非上市公募基金的投资

对于非上市公募基金,基金经理将主要关注基金管理团队、资产规模、流动性、投资策略、投资业绩、汇率风险等基本情况,从而确定基金投资对象。

基金经理将在充分考虑以上因素的情况下,选择有优秀的基金管理团队、资产规模较大、流动性充裕、信用风险低、汇率风险小的非上市公募基金。

2.3 衍生品的投资

金融衍生品的投资决策流程主要包括研究支持、投资决策、交易执行、绩效与风险评估等阶段。

公司结构产品投资部负责金融衍生品的研究工作,对各主要金融衍生品市场进行日常研究,定期或不定期提供相关投资建议的报告,跟踪衍生品交易对手的信用状况。

基金经理在内外部研究的支持下,本着组合避险和有效管理的策略原则,提出衍生品投资需求,结构产品投资部提供相应的投资及风险评估分析报告。

根据拟投资金融衍生品的金额、风险敞口的大小,基金经理将投资方案提交投资总监或投资决策委员会审批。审批通过后,基金经理将投资指令提交交易部执行。

在定期或不定期召开的投资决策委员会会议上,基金经理对金融衍生品的投资运作情况进行回顾和评估检讨。

2.4 现金管理

持有一定比例的现金资产是基金保持流动性的必然要求,但现金资产的持有将会影响到本基金的跟踪效果,形成现金拖累。本基金将综合考虑基金申购赎回、金价波动等因素,在保证基金流动性需求的前提下,通过量化模型计算出最佳现金持有量,从而提高现金资产使用效率,缩小本基金的跟踪误差。

2.5 风险控制与评估

公司风险控制委员会定期召开会议,对基金投资组合进行风险评估,并提出风险控制意见。

（六） 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：（经汇率调整后的）伦敦金价格，其中伦敦金价格使用伦敦金每日下午收盘价（London Gold Price PM Fix）；人民币汇率以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

由于本基金主要投资于有实物黄金支持（Physical gold underlying）的黄金 ETF，而黄金 ETF 的业绩比较基准基本采用伦敦金下午收盘价或者纽约商品交易所（COMEX）的黄金期货当月合约价格（gold future spot settlement price），前者主要运用于实物支持的黄金 ETF，因此伦敦金下午收盘价比较符合本基金的产品特性。

伦敦金下午收盘价由伦敦金银市场协会（London Bullion Market Association, LBMA）所产生。伦敦金银市场协会旗下的伦敦黄金市场，是世界上最大、历史最悠久的黄金 OTC 市场。它的会员涵盖全球持有黄金的主要央行，以及来自世界各地的黄金生产商、精炼商、加工商及其他贸易商。

伦敦金定价限制由五名成员正式参与，各成员为黄金交易商及 LBMA 的成员。主席职位每年在五名成员公司之间轮换。定价现以电话方式厘定，该五名成员公司毋须如过往一般会面厘定。上午时段的定价由伦敦时间上午十时三十分开始，下午时段的定价由伦敦时间下午三时正开始。为黄金定价的现行成员为 Bank of Nova Scotia - ScotiaMocatta, Barclays Bank plc, Deutsche Bank AG, HSBC Bank USA, N.A. 及 Société Générale。其他市场参与者如欲参与定价买卖，必须通过该五名黄金定价成员之一进行。

如果今后法律法规发生变化，或者由于伦敦金价格定价标准发生重大变更等原因导致伦敦金下午收盘价不宜继续作为业绩比较基准，或者市场上出现更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准，基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（七） 风险收益特征

本基金属于基金中基金，主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具。本基金的表现与黄金价格走势直接相关，历史上黄金价格波幅较大，波动周期较长，预期收益可能长期超过或低于股票、债券等传统金融资产。此外，本基金主要投资海外，存在汇率风险。

（八） 投资限制

下列投资限制（包括禁止行为、投资组合限制、投资境外基金的限制、金融衍生品投资限制、证券借贷交易限制、回购交易限制等）为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的

有关限制性规定，如法律法规或监管部门取消下列限制性或禁止性规定，本基金履行适当程序后可不受上述规定的限制。

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向基金管理人、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债券；
- (14) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- (15) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (16) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。
- (2) 基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(3) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

(4) 基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本公司管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。

上述投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(5) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

上述“非流动性资产”是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(6) 本公司管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

(7) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

(8) 每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞形基金的，该伞形基金应当视为一只基金。

(9) 本基金不得投资于以下基金：

- a) 其他基金中基金；
- b) 联接基金（A Feeder Fund）；
- c) 投资于前述两项基金的伞形基金子基金。

(10) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述各项投资比例限制的，基金管理人应当在三十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。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，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。

3、金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

(1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

(2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

(a) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

(b) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

(c) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(4) 基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

4. 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

(a) 现金；

(b) 存款证明；

(c) 商业票据；

(d) 政府债券；

(e) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(7) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(8) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(9) 基金参与证券借贷交易，所有已借出而未归还证券总市值不得超过基金总资产的 50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。

5. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。本项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

《基金法》、《试行办法》、《通知》及其他有关法律法规或监管部门取消第3至6条投资限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

1、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；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（十）基金的融资、融券

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融资、融券。

（十一） 代理投票

代理投票应遵循基金持有人利益最大化的原则，根据这一原则，公司制订了代理投票指引。代理投票前，基金经理小组将充分研究提案的合理性，并综合考虑独立第三方研究机构和反对者的意见后，拟定。

通常情况，在不损害基金持有人利益的前提下，本基金将不参与有锁定期要求和支付较高费用的投票事项。

（十二） 证券交易

基金管理人已建立《交易券商选择、评价、交易量分配以及交易佣金返还管理制度》。基金管理人将重点根据研究服务、交易服务、销售服务、投资策略服务、市场及后台服务等评价指标选择交易券商。

上述管理制度对不同评价指标设置了评价权重，相关人员依据管理制度对交易券商研究报告的质量、研究覆盖宽度和深度、交易效率和效果、最佳交易执行等其他服务质量进行评价。本基金将依据综合评价结果确定交易券商交易量的分配。评价报告每年进行一次，并根据评价结果进行适当调整。

公司将严格遵守监管规定和与经纪商签订的协议，按照市场惯例确定佣金费率。遵循的基本准则是：佣金是基金持有人的财产，基金管理人有责任尽可能减降交易成本，执行最有利于基金持有人利益的交易。本基金佣金的分配情况将依法定期进行披露。

软佣金只有在符合下列所有条件时方可接受。

- （1）经纪人提供最好的交易执行；
- （2）本公司对服务满意，并且相关服务不会导致对客户利益造成损害。

任何软佣金安排必须事先获得公司风险委员会的批准。所有的软佣金纪录将保留在基金核算部门，保存时间为 20 年。

（十三） 基金投资风险管理

本基金为基金中基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。本基金将通过跟踪误差和跟踪偏离度等风险控制指标对基金投资绩效和风险进行识别和监督。

1) 跟踪误差

如果选择以投资标的的 NAV 来计算跟踪误差，本基金将采用如下公式计算跟踪误差：

$$TE = \sqrt{T} \times \sqrt{\frac{1}{N-1} \sum_{t=1}^N (R_{p,t} - R_{B,t})^2}$$

上述公式中各参数的定义如下：

T：表示当年交易日天数；

N：表示计算周期；

$R_{p,t}$ ：表示 t 日基金份额单位净值的日收益率

其中，t 日基金份额单位净值以经过汇率调整后的基金资产组合中证券的 t 日 NAV 来进行估值

$R_{B,t}$ ：表示 t 日业绩比较基准的日收益率

如果选择以投资标的二级市场收盘价来计算跟踪误差，本基金将采用如下公式计算跟踪误差：

$$TE = \sqrt{T} \times \sqrt{\frac{1}{N-1} \sum_{t=1}^N (R_{p,t} - R_{B,t})^2}$$

上述公式中各参数的定义如下：

T：表示当年交易日天数；

N：表示计算周期；

$R_{p,t}$ ：表示 t 日基金份额单位净值的日收益率

其中，t 日基金份额单位净值以经过汇率调整后的基金资产组合中证券的二级市场收盘价来进行估值

$R_{B,t}$ ：表示 t 日业绩比较基准的日收益率。

2) 跟踪偏离度

如果选择以投资标的证券二级市场收盘价来计算跟踪偏离度，本基金将采用如下公式：

$$\text{跟踪偏离度} = \frac{P_{t1} - P_{t0}}{P_{t0}} - \frac{B_{t1} - B_{t0}}{B_{t0}}$$

P_{t0} 为期初基金份额单位净值

P_{t1} 为期末基金份额单位净值

B_{t0} 为期初基准金价

B_{t1} 为期末基准金价

其中，基金份额单位净值以经过汇率调整后的基金资产组合中证券的二级市场收盘价来进行估值。”

如果选择以投资标的证券 NAV 来计算累计偏差，本基金将采用如下公式计算：

$$\text{累计偏差} = \frac{P_{t1} - P_{t0}}{P_{t0}} - \frac{B_{t1} - B_{t0}}{B_{t0}}$$

P_{t0} 为期初基金份额单位净值

P_{t1} 为期末基金份额单位净值

B_{t0} 为期初基准金价

B_{t1} 为期末基准金价

其中，基金份额单位净值以经过汇率调整后的基金资产组合中证券的 NAV 来进行估值。

根据目前国际惯例，黄金 ETF 的每日基金净值（NAV）一般以 T 日伦敦金下午收盘价（LN PM FIX）减去 ETF 相应费用为计算依据。伦敦金下午收盘价的定价由每日伦敦时间下午三时正开始。由于时差原因，全球不同地区黄金 ETF 的基金净值计算时间可能不同于当日 ETF 二级市场收盘时间。另外由于国际黄金价格实行 24 小时连续报价的特殊性，T 日伦敦金下午收盘价后黄金现货价格（spot price）将继续随着市场供求关系、投资者预期等因素不断变化，导致黄金 ETF 的 T 日二级市场收盘价与 T 日基金净值之间出现一定程度、甚至较大的偏离。目前我国 QDII 规则规定 ETF 等交易所交易品种以二级市场收盘价计算基

金净值，与海外黄金 ETF 直接以所跟踪标的（伦敦金下午收盘价）来计算基金净值存在较大区别。投资者以本基金的基金净值计算的跟踪误差和累计偏离度可能由于上述原因不能正确反映其跟踪效果。

（十四） 衍生品投资风险管理

金融衍生品的投资过程，同时也是风险管理的过程。在金融衍生品的投资业务中，包括了“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的全过程、多角度、全方位的风险监控体系。

事前风险控制：投资决策前，投资研究人员必须对所运用的金融衍生品的原理、特性、运作机制、风险有深入的研究和分析。对拟投资方案可能蕴含的风险进行充分评估，并进行必要的情形分析和压力测试。金融衍生品的投资方案经投资总监或投资决策委员会审批通过后，方可执行。

事中风险控制：结构产品投资部对交易对手的信用评级进行跟踪，防范信用风险的发生，并利用现代金融工程的手段对组合进行风险评估。基金经理或结构产品投资部对衍生品头寸以及风险敞口进行监控，一旦衍生品的亏损超过投资方案防范的目标，立即向投资决策委员会汇报，考虑采取强制平仓等措施以避免出现严重的风险事件。

事后风险控制：基金经理或结构产品投资部定期对基金的衍生品交易策略、运作情况做投资回顾分析和风险评估，识别内部控制中的弱点和系统中的不足，提供改进的建议；定期评估、审定和改进风险管理政策。

（十五） 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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 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 2026 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-

	其中：普通股	—	—
	优先股	—	—
	存托凭证	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	338,289,522.73	90.65
3	固定收益投资	506,312.74	0.14
	其中：债券	506,312.74	0.14
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	32,179,417.95	8.62
8	其他资产	2,222,607.54	0.60
9	合计	373,197,860.96	100.00

2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

无。

3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

4. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

无。

5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
AAA	—	—
AA+	—	—
AA	—	—
AA-	—	—
A+	506,312.74	0.14
A	—	—

A-	-	-
BBB+	-	-
BBB	-	-
BBB-	-	-
BB+	-	-
BB	-	-
BB-	-	-
B+	-	-
B	-	-
B-	-	-
CCC+	-	-
CCC	-	-
CCC-	-	-

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	500,000	506,312.74	0.14

注：（1）报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券；（2）数量列示债券面值，以外币计价的债券面值按照期末中国人民银行公布的人民币兑外币汇率中间价折算为人民币。

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

无。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

9. 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR Gold Shares	ETF	交易型开放式	State Street Global Advisors Inc	61,743,964.81	17.31
2	abrdn	ETF	交易型	ETF	61,737,567.53	17.31

	Physical Gold Shares ETF		开放式	Securities US LLC		
3	iShares Gold Trust	ETF	交易型 开放式	BlackRock Fund Advisors	60,839,603.70	17.06
4	Swisscanto CH Gold ETF	ETF	交易型 开放式	Swisscanto Fondsleitung AG	58,724,540.14	16.47
5	UBS Gold ETF	ETF	交易型 开放式	UBS Fund Management Switzerland AG	57,624,221.81	16.16
6	iShares Gold ETF CH	ETF	交易型 开放式	BlackRock Asset Management Schweiz AG	37,619,624.74	10.55

注：报告期末，本基金仅持有上述 6 只基金。

10. 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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（人民币元）
1	存出保证金	33.31
2	应收证券清算款	2,222,574.23
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,222,607.54

(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

无。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

五、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
2011 年 8 月 4 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日	-7.00%	0.64%	-10.32%	1.79%	3.32%	-1.15%
2012 年	0.65%	0.82%	8.00%	1.05%	-7.35%	-0.23%
2013 年	-30.13%	1.19%	-29.51%	1.32%	-0.62%	-0.13%
2014 年	-2.60%	0.78%	0.49%	0.82%	-3.09%	-0.04%
2015 年	-5.81%	0.81%	-6.73%	0.91%	0.92%	-0.10%
2016 年	13.17%	0.90%	15.49%	1.04%	-2.32%	-0.14%
2017 年	3.83%	0.58%	6.12%	0.66%	-2.29%	-0.08%
2018 年	1.42%	0.58%	4.06%	0.58%	-2.64%	0.00%
2019 年	17.06%	0.65%	20.38%	0.75%	-3.32%	-0.10%
2020 年	13.14%	1.14%	16.55%	1.30%	-3.41%	-0.16%
2021 年	-7.60%	0.87%	-6.52%	0.98%	-1.08%	-0.11%
2022 年	7.20%	0.88%	9.71%	0.91%	-2.51%	-0.03%
2023 年	12.05%	0.74%	16.53%	0.81%	-4.48%	-0.07%
2024 年	24.45%	0.84%	27.41%	0.89%	-2.96%	-0.05%
2025 年	54.97%	1.12%	63.69%	1.20%	-8.72%	-0.08%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	-10.80%	1.87%	-10.68%	2.04%	-0.12%	-0.17%

该时间区间历任基金经理

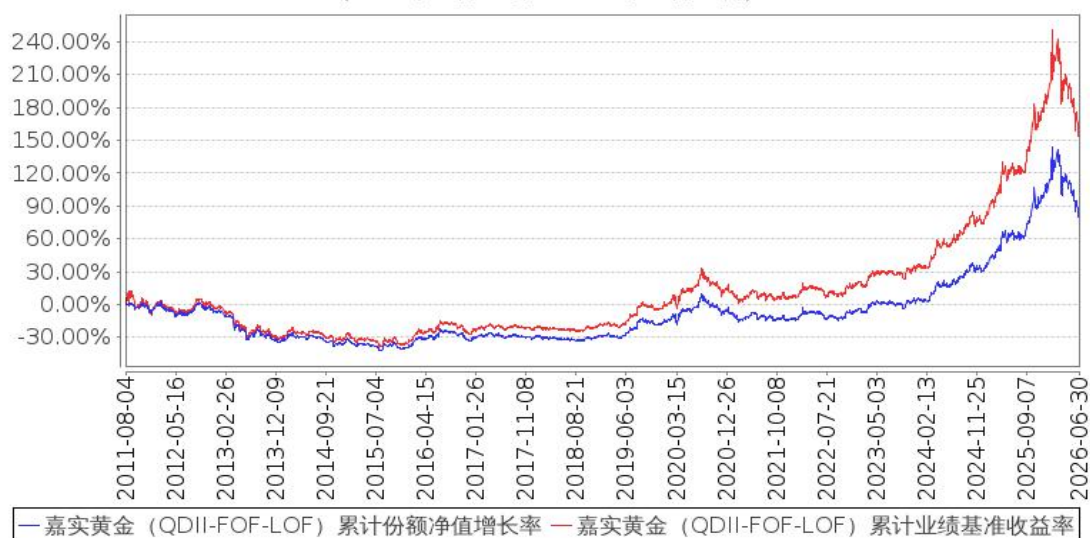
杨阳先生，管理时间为 2011 年 8 月 4 日至 2014 年 3 月 11 日；杨宇先生，管理时间为 2014 年 3 月 11 日至 2016 年 1 月 5 日；何如女士，管理时间为 2016 年 1 月 5 日至 2019 年 9 月 28 日；陈正宪先生，管理时间为 2016 年 1 月 5 日至 2021 年 9 月 24 日；高峰先生，管理

时间为2019年9月28日至2021年7月2日；李直先生，管理时间为2021年7月2日至2023年4月12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

嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）累计份额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

（2011年08月04日至2026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6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。

六、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A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	罗朝伟

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立。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

安国勇先生，董事长，博士研究生，中共党员。曾任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，中诚信托有限责任公司党委书记、总裁。

王会妙女士，董事，北京大学经济学博士。曾就职于河北定州师范学院、国投信托有限责任公司。2011年5月加入中诚信托有限责任公司，曾任信托业务总部业务团队负责人（MD）、信托业务三部总经理、财富管理中心副总经理、资产配置部总经理、中诚资本管理（北京）有限公司总经理等职，现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁。

Markus Johann Kobler 先生，董事，瑞士、英国及德国国籍。毕业于瑞士巴塞尔大学（University of Basel），获经济学博士学位。加入 DWS Group 前，Markus Johann Kobler 先生于 1993 年至 2023 年期间先后担任学术研究、管理咨询、金融服务及高级管理职务，曾

任职于瑞士巴塞尔大学（University of Basel）、麦肯锡公司（McKinsey & Company）、瑞士宝盛银行（Bank Julius Baer & Co. AG）及安联环球投资（Allianz Global Investors）等机构。Markus Johann Kobler 先生于 2023 年 11 月加入 DWS Group，目前担任管理委员会成员（Member of the Management Board）、首席财务官（Chief Financial Officer）及首席财务官部门负责人（Head of the CFO Division）。

沈铠圻（Heidi Sum）女士，董事，中国香港籍，毕业于香港大学，获工学学士学位，并持有特许金融分析师（CFA）资格及英国皇家特许测量师学会会员（MRICS）资格。沈铠圻女士拥有逾二十年亚太及全球资产管理、房地产投资及实物资产投资经验。加入 DWS Group 前，曾于新鸿基地产发展有限公司、领盛投资管理公司（LaSalle Investment Management）、嘉民集团（Goodman Group）及月桥资本有限公司（Moonbridge Capital）任职，从事房地产投资、私募房地产基金管理及相关投资管理工作。2014 年 9 月加入 DWS Group，先后担任亚太区主动股票及流动实物资产产品专家主管、亚太区产品主管等职务，现任董事总经理、全球流动实物资产产品主管。

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，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。现兼任神州数码信息服务股份有限公司独立董事、北京首创生态环保集团股份有限公司独立董事、美年大健康产业控股股份有限公司独立董事。

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主任、清华大学全球私募股权研究院副院长。曾兼任中国证监会第一、二届并购重组审核委员会委员，中国上市公司协会第一、二届独立董事委员会主任委员、上海证券交易所第四、五届上市委员会委员。现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、深圳证券交易所法律专业咨询委员会委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员、中国上市公司协会学术顾问委员会委员、银行间市场交易商协会法律专业委员会委员。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，现任明石创新技术集团股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。现兼任重庆国际信托股份有限

公司独立董事、中国人寿养老保险股份有限公司独立董事、深圳光韵达光电科技股份有限公司独立董事、赞同科技股份有限公司独立董事、爱美客技术发展股份有限公司董事。

类承曜先生，独立董事，中共党员，中国人民大学财政金融学院财政系专业毕业，经济学博士。现任中国人民大学财政金融学院金融学教授、博士生导师、中债研究所所长，兼任 International Journal of Innovation and Entrepreneurship 中方副主编、《投资研究》编委会委员等职。2020 年受聘为财政部财政风险研究专家工作室专家。现兼任余姚农商行独立董事。

经雷先生，董事，总经理，财务负责人，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）。1998 年 6 月至 2008 年 5 月在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部从事研究投资工作；2008 年 5 月至 2013 年 9 月，历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人；2013 年 10 月入职嘉实基金管理有限公司，2013 年 10 月至 2018 年 3 月任机构投资和固定收益业务首席投资官；2018 年 3 月至今任嘉实基金管理有限公司总经理；2018 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

沈树忠先生，监事长，正高级会计师，管理学硕士。曾任中国糖业酒类集团公司财务部科员、财务部副经理、审计部经理、财务部经理、财务总监、副总经理、常务副总经理（主持工作）、法定代表人；兼任北京华堂商场有限公司董事、中日合资成都伊藤洋华堂商场有限公司副董事长、酒鬼酒股份有限公司董事。现任中诚信托有限责任公司财务总监。

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，立信投资有限公司财务总监。现任立信投资有限公司监事。

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，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监兼董事会办公室主任。

马莲女士，监事，法学博士，中共党员。曾任北京市竞天公诚律师事务所律师，法国基德律师事务所北京代表处法律顾问，北京天驰律师事务所律师、合伙人。2013 年 9 月加入嘉实资本管理有限公司，历任法律合规总监、首席风控官。2020 年 6 月至 2025 年 7 月任嘉实财富管理有限公司副总经理、风控合规负责人。现任嘉实基金管理有限公司审计部总监。

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。

姚志鹏先生，副总经理，硕士研究生。2011 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任股票研究部研究员、基金经理、成长风格投资总监兼权益投资部总监、股票投研首席投资官，现任公司副总经理。

鲁令飞先生，副总经理，硕士研究生。2000年10月加入嘉实基金管理有限公司，历任机构业务部机构销售、保险业务部总监、机构销售业务板块负责人，现任公司副总经理、首席市场官。

张敏女士，副总经理，博士研究生。2010年3月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部副总监、总监、首席风险官，现任公司副总经理、养老首席投资官。

刘伟先生，首席信息官，硕士研究生。2010年4月加入嘉实基金管理有限公司，历任信息技术部高级软件工程师、C-Lab科技总监、数字业务部总监，现任公司首席信息官。

张丹华先生，副总经理，博士研究生。2011年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究组研究员、研究部副总监、研究部总监、科技行业投资总监、AI Lab负责人，现任公司副总经理、股票投资首席投资官。

2、投资总监

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。

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

张钟玉女士，硕士研究生，16年证券从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。曾任大成基金管理有限公司研究员、数量分析师、基金经理。2021年9月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部。2015年2月28日至2021年9月2日任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2015年2月28日至2021年9月2日任

大成沪深300指数证券投资基金基金经理,2019年2月28日至2021年9月2日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年2月28日至2021年9月2日任大成MSCI中国A股质优价值100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022年1月25日至2022年12月26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、2022年1月27日至2022年9月20日任嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年5月18日至2026年3月12日任嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年11月24日至2024年1月11日任嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2022年12月29日至2025年2月14日任嘉实中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2023年4月12日至2024年9月13日任嘉实恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。2022年1月25日至今任嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理、2022年1月27日至今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、2022年1月27日至今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、2022年4月13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、2022年9月15日至今任嘉实纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理、2022年10月20日至今任嘉实中证全指证券公司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、2023年3月2日至今任嘉实上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理、2023年4月12日至今任嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金经理、2023年4月27日至今任嘉实国证通信交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2023年5月31日至今任嘉实纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2023年9月11日至今任嘉实国证通信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、2023年11月2日至今任嘉实标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2023年12月26日至今任嘉实标普生物科技精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2024年4月3日至今任嘉实德国DAX交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理、2025年7月17日至今任嘉实中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

杨阳先生，管理时间为2011年8月4日至2014年3月11日；杨宇先生，管理时间为2014年3月11日至2016年1月5日；何如女士，管理时间为2016年1月5日至2019年9月28日；陈正宪先生，管理时间为2016年1月5日至2021年9月24日；高峰先生，管理时间为2019年9月28日至2021年7月2日；李直先生，管理时间为2021年7月2日至2023年4月12日。

4、海外投资决策委员会

海外投资决策委员会的成员包括：嘉实国际资产管理有限公司首席投资官蒋一茜女士，嘉实国际资产管理有限公司总经理陈志新先生，固收基金经理顾俊伦先生，股票基金经理张琴女士，ETF基金经理高峰先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、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、办理与基金资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、保存基金资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他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- （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；
- （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）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- （3）不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人内部控制制度

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。董事会下设合规与风险控制委员会，督促公司经理层履行职责建立有效的财务控制、内部控制的系统及制度，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）投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、投资总监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、督察长及部门总监组成，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资产的状况。

（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。

七、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《试行办法》、《通知》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会2011年5月31日《关于核准嘉实黄金证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]839号）核准募集。

（二）基金类别、运作方式及存续期间

基金类别：基金中基金（FOF）

基金运作方式：上市契约型开放式

存续期间：不定期

（三）募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集规模

1、募集期限：2011年7月4日到2011年7月29日

2、募集方式及场所：

本基金通过场内和场外两种方式发售。

（1）场内发售

场内发售是指本基金募集期结束前获得基金销售资格的深圳证券交易所会员单位通过场内代理发售基金份额的行为（具体名单见基金份额《发售公告》或相关业务公告）。尚未取得基金销售资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后通过深圳证券交易所交易系统为投资者提供本基金的上市交易服务。

（2）场外发售

场外发售是指通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及非直销销售机构的销售网点，具体名单见基金份额《发售公告》）通过场外公开发售基金份额的行为。

（3）通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下；通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回；登记在证券登记结算系统中的基金份额如需办理场外赎回，应当办理跨系统转托管后方能实施。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。登记在注册登记系统中的基金份额如需办理场内赎回，应当办理跨系统转托管后方能实施。

（4）除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

3、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，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。

4、募集规模上限：

本基金首次募集份额目标上限为50亿元，募集规模的具体方案详见份额发售公告。

（四）募集币种

人民币

（五）基金面值、认购费用、认购价格及计算公式

1、基金面值

本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。

2、认购价格

本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00 元。

3、认购费率

1)、场外认购：投资者在场外认购本基金时需交纳前端认购费，费率按认购金额递减，具体如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M<100万元	0.6%
100万元≤M<200万元	0.3%
200万元≤M<500万元	0.1%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

2)、场内认购：场内会员单位可按照基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定投资人场内认购的佣金比率。

3)、本基金认购费由认购人承担，认购费不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

4)、投资者重复认购时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

4、认购份额的计算：

1)、场外认购的份额计算：

基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率);

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额;

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值。

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分截去，由此产生的误差计入基金财产。

2)、场内认购份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

认购费用 = 挂牌价格 × 认购份额 × 认购费率

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用

利息折算的份额 = 利息 / 挂牌价格

场内认购金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

（六）募集资金利息的处理方式

确认成功的认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资者所有。其中利息的数额以基金注册机构的记录为准。

（七）募集期间的资金与费用

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。

八、基金合同的生效

（一）基金合同生效

本基金基金合同于 2011 年 8 月 4 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）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 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并报送解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

九、基金份额的上市交易

（一）上市交易的时间和地点

- 1、上市交易的地点：深圳证券交易所
- 2、上市交易的时间：2012年2月10日

（二）上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵照《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》等有关规定，包括但不限于：

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为上市前最新公布的基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例限制为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- 5、本基金适用大宗交易的有关规则。

（三）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（四）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金最新公布的基金份额净值。

（五）上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的有关规定执行。本基金上市后，若出现以下情形，基金管理人向深圳证券交易所申请本基金停牌，并由深圳证券交易所决定是否停牌及停、复牌时间。

- 1、当基金管理人预计已使用外汇额度接近国家外汇局批准的境外证券投资额度上限时，基金管理人可发布交易风险提示公告，向基金投资者提示风险，并向深圳证券交易所申请本基金于公告日上午开市起停牌一小时；
- 2、当本基金因外汇额度原因暂停申购时，本基金管理人应向深圳证券交易所申请在刊登暂停申购公告当日对本基金停牌，并于下一交易日复牌；
- 3、本基金因外汇额度原因暂停申购期间，基金管理人向国家外汇局申请增加外汇额度并获得批准时，应及时发布公告，披露恢复申购的时间，并向深圳证券交易所申请于公告当日停牌、于下一交易日复牌；
- 4、若因暂停申购导致本基金折溢价率出现异常，本基金管理人将根据深圳证券交易所的要求进行风险提示，并向深圳证券交易所申请本基金于提示公告日上午开市起停牌一小时。

若未来对上述情形有更合适的处理措施，本基金管理人可根据法律法规、深圳证券交易所相关规定对上述措施进行调整及修改。

（六）暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、 不再具备本条“（一）基金的上市”中规定的上市条件；
- 2、 违反国家有关法律、法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、 严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》；
- 4、 深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在指定媒介上刊登暂停上市公告。

（七）恢复上市的公告

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，并在指定媒介上刊登恢复上市公告。

（八）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

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

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在指定媒介上刊登终止上市公告。

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

十、基金份额的申购、赎回

本基金为上市契约型开放式基金，投资者可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式，实现基金份额的日常交易。

办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

（一）申购、赎回的场所

投资者可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务，场内非直销销售机构包括深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单见本基金相关业务公告）。投资者还可使用开放式基金账户，通过基金管理人和基金管理人委托的非直销销售机构办理场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外非直销销售机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外非直销销售机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

基金管理人可根据情况变更或增减非直销销售机构，并在基金管理人网站公示。

（二）申购、赎回的开放日及时间

本基金自 2011 年 9 月 15 日起办理申购与赎回业务。

本基金申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及纽约证券交易所、伦敦证券交易所、苏黎世证券交易所同时开放交易的每个工作日，但基金管理人根据法律法规根据法律法规、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。场内申购、赎回业务办理时间为 9:30-11:30 和 13:00-15:00；场外申购、赎回业务开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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有关规定在指定媒介上公告。

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

（三）申购、赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请，同时，场内申购和赎回申报单位应以深圳证券交易所的规定为准；

3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人份额确认的先后次序进行顺序赎回；

4、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

5、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

6、基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须按有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购和赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

投资者通过非直销销售机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币1元，投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元（已通过本基金非直销销售机构或/及直销中心认购本基金者除外），投资者通过直销中心柜台追加申购单笔最低限额为人民币1,000元；通过非直销销售机构或嘉实基金管理有限公司网上直销追加申购单笔最低限额为人民币1元。但若有非直销销售机构特别约定首次申购单笔及追加单笔最低限额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定除外。

2、申请赎回基金的份额

投资者通过直销中心柜台单笔赎回不得少于1,000份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足1,000份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

投资人在场外赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；单笔赎回不得少于1份，每个场外基金交易账户最低持有基金份额余额为1份，若某笔赎回导致某一场外销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于1份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。投资者通过非直销销售机构赎回本基金的具体单笔赎回最低份额以各销售机构规定为准。

3、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。

4、基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前在指定媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

（五）申购、赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

对于场外申购和赎回，投资人必须根据场外销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

对于场内申购和赎回，基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

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

2、申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金管理人在T+2日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在T+3日（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

业务办理单位对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表业务办理单位确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整并公告。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的非直销销售机构将投资人已缴付的申购款项本金退回投资者账户。

投资人T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+10日内（包括该日）将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

（六）申购、赎回的费率

1、本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者在申购本基金时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

申购金额(含申购费)	申购费率
M<100 万元	0.8%
100 万元≤M<200 万元	0.5%
200 万元≤M<500 万元	0.3%
M≥500 万元	按笔收取，1000 元/笔

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其

申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注：2013年4月9日，本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自2013年4月12日起，在本公司基金网上直销系统开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和非直销销售机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，除此之外的赎回费总额的25%归入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

通过场外赎回基金份额，以基金登记系统确认份额的顺序，按照“先进先出”的原则适用赎回费率。场外具体赎回费率如下：

持有期限（M）	赎回费率
M < 7 天	1.5%
7 天 ≤ M < 365 天	0.5%
365 天 ≤ M < 730 天	0.3%
≥ 730 天	0

场内具体赎回费率如下：

持有期限（M）	赎回费率
M < 7天	1.5%
M ≥ 7天	0.5%

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定

基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、本基金申购、赎回的币种为人民币,基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下,接受其它币种的申购、赎回,并提前公告。

（七）申购份额、赎回金额及余额的处理方式的计算方式

1、场外申购份额与赎回金额的计算

（1）场外基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例如,某投资者投资 5,000 元申购本基金,对应费率为 0.8%,假设申购当日基金份额净值为 1.128 元,则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = $5,000 / (1 + 0.8\%) = 4,960.32$ 元

申购费用 = $5,000 - 4,960.32 = 39.68$ 元

申购份数 = $4960.32 / 1.128 = 4,397.45$ 份

即：某投资者投资 5,000 元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为 1.128 元,则可以得到 4,397.45 份基金份额。

（2）场外基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式,赎回金额以 T 日的基金份额净值为准进行计算,计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例如：假定三笔赎回申请的赎回份额均为 10,000 份,但持有时间长短不同,其中基金份额净值为假设数,那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额（份，A）	10,000	10,000	10,000
基金份额净值（元，B）	1.100	1.300	1.400

持有时间	100天	366天	731天
适用赎回费率（C）	0.5%	0.3%	0%
赎回总额（元，D=A×B）	11,000	13,000	14,000
赎回费（E=C×D）	55	39	0
赎回金额（F=D-E）	10,945	12,961	14,000

（3）场外申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（4）场外赎回金额的处理方式：

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用来计算，赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

2、场内申购份额与赎回金额的计算

（1）场内基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

申购份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例如：某投资者通过场内投资 10,000 元申购本基金，对应的申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = $10,000 / (1 + 0.8\%) = 9,920.63$ 元

申购手续费 = $10,000 - 9,920.63 = 79.37$ 元

申购份额 = $9,920.63 / 1.0250 = 9,678.66$ 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,678 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

实际净申购金额 = $9,678 \times 1.025 = 9,919.95$ 元

退款金额=10,000-9,919.95-79.37=0.68 元

即：投资者投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,679 份，退款 0.68 元。

（2）场内基金赎回金额的计算 采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某投资者从场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持有期限超过 7 天，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60 元

即：投资者从深圳证券交易所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持有期限超过 7 天，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。

T 日的基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留在小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。由此产生的误差在基金财产中列支。

基金管理人每个工作日日终对前一日的基金资产估值后，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。

（八）申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，如出现单个基金份额持有人超过前一日基金总份额30%的赎回申请（“大额赎回申请人”）的，基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在三个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在指定媒介予以公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过二十个工作日，并应当在指定媒介公告。

（十）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场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）本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；

（4）因基金收益分配或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派或发生重大事项可能导致净值的较大波动等原因，使基金管理人认为继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；

（5）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术保障或人员伤亡导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

（6）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（7）基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）；

（8）继续接受申购可能导致突破国家外汇局批准的外汇额度；

（9）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（10）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；

（11）深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购业务的；

（12）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暂停接受基金申购申请的措施；

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

（14）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）至（9）、（11）、（12）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

2、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- （1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场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）本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；
- （4）因市场剧烈波动或其他原因而发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （5）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- （6）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术保障或人员伤亡导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- （7）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （8）深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回业务的；
- （9）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款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
- （10）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在 20 个工作日内予以支付。

同时，在出现上述第（4）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，但延缓期限不得超过二十个工作日，并在指定媒介公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

如果发生暂停的时间为一个开放日，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一个开放日但少于十个开放日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过十个开放日，暂停期间，基金管理人应每十个开放日至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（十一）基金转换

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

（十二）定期定额投资计划

2011年9月15日起基金管理人开始为投资人办理本基金基金份额的定期定额投资计划，具体规则请参见基金管理人网站发布的相关公告。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款日、扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十三）转托管

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

1、系统内转托管

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

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

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

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金非直销销售机构的业务规则。

2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管业务，并收取一定的手续费用。

（十四）基金的非交易过户

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户业务，并收取一定的手续费用。

（十五）基金的冻结与解冻

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则，受理基金份额的冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

十一、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（含境外资产托管人收取的费用）；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费，税务代理费等根据有关法规、《基金合同》及相应协议的规定，由基金管理人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 9、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等；基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）
- 10、与基金有关的诉讼、追索费用；但由基金管理人或托管人自身原因造成的此类费用由基金管理人或托管人自行承担；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用；
- 12、因更换境外托管人而进行的资产转移所产生的费用；但由基金管理人或托管人自身原因造成的此类费用由基金管理人或托管人自行承担；

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.26% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.26\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）、基金费用的种类”中第 3—12 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

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

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金资产的账户

根据投资所在地规定及境外托管人的相关要求，基金托管人、境外托管人可以以基金名义或托管人名义开立证券账户和现金账户，保证上述账户与基金托管人及境外托管人的财产独立，并与基金托管人及境外托管人的其他托管账户相独立。

（四）基金资产的保管及处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金非直销销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。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。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

在符合本合同和托管协议有关资产保管的要求下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。基金托管人存在故意或过失行为的，应承担赔偿责任。

基金管理人和基金托管人可将其义务委托第三方，并对该受托的第三方处理有关本基金事务的行为承担责任。

基金托管人及其委托的境外托管人应妥善保存基金管理人基金财产汇入、汇出、兑换、收汇、现金往来及证券交易的记录、凭证等相关资料，并按规定的期限保管，在符合法律法规以及基金合同规定的前提下，基金托管人委托的境外托管人持有的与境外托管人账户相关的资料的保管可按照境外托管人的业务惯例保管。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为本基金的开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日。T+1 日完成 T 日估值，估值日后 2 个工作日内披露。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、基金份额和银行存款本息等资产和负债。

（四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人应于 T+1 日完成 T 日估值，并将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；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。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

（五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市股票的估值

①送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

②首次发行且未上市的股票，按成本价估值；首次发行且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估值。

2、债券估值方法

（1）对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。证券交易所市场未实

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，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

（2）对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

3、衍生品估值方法

（1）上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值模型确定公允价值。

4、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

5、基金估值方法

（1）ETF等上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）其他基金按公布的最近交易日的基金份额净值估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。

如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，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。

7、汇率

本基金外币资产价值计算中，所涉及人民币对美元、港币、英镑、欧元、日元的汇率应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

8、. 税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

9、在任何情况下，基金管理人如采用本款第1—8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，如果基金管理人认为按本款第1—8项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

10、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或非直销销售机构、或投资者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的当事人（“受损方”）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无法预见、无法避免、无法抗拒，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者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

因基金估值错误给基金投资人造成的损失应由基金托管人和基金管理人协商共同承担，基金托管人和基金管理人对其不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿，基金合同的当事人应将按照以下约定处理。

（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，给当事人造成的损失由差错责任方承担；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，则有协助义务的当事人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）差错的责任方对可能导致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，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）基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5% 时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人 和 托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金托管人负责向差错方追偿。

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；其中基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5% 时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；基金份额净值计算差错达到或超过基金份额净值 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

（七）暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因休市或暂停交易时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

4、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故；

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

6、中国证监会认定的其他情形。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券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、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。

十四、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

十五、基金的会计和审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
- 8、基金管理人应在会计年度结束后60个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的、具有证券、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的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人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。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，依照《信息披露办法》的有关规定将应予披露的基金信息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，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（A）《招募说明书》、《基金合同》、《托管协议》、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将《招募说明书》、《基金合同》摘要登载在指定媒体；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、《托管协议》登载在网站上。

1、《招募说明书》应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当

在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；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。

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

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

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在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。

（B）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《发售公告》，并在披露《招募说明书》的当日登载于指定媒介。

（C）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体登载《基金合同》生效公告。

（D）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳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前至少3个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（E）基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当不晚于每个估值日后2个工作日内通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露估值日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的后一个工作日的次日，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。

（F）基金份额申购、赎回价格

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

（G）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，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。

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。

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。

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

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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（H）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、境外托管人、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、基金托管人或境外托管人的法定名称、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 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

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

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、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百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、基金暂停上市、恢复上市或终止上市；

22、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；

23、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。

（I）澄清公告

在《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。

（J）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

（K）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。

（L）中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

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

基金管理人、基金托管人应当在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、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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。

（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及基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

（八）本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。

十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）终止《基金合同》，但在基金规模低于 5000 万元的情况下除外；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整相关业务规则；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应按照届时有效的法律法规报中国证监会核准或备案，自生效的次日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、若基金规模低于 5000 万元，基金管理人有权在不召开基金份额持有人大会的情况下终止基金合同；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金资产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、清算程序

（1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月，自基金财产清算小组成立之日起算。

（四）清算费用

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

（五）财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》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小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

十八、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2026 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 209 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2026 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1577 只。自 2003 年以来，本行连续二十二年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 113 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制 COSO 准则从控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新

情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从2005年至今，中国工商银行资产托管部共十九次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

1. 内部控制目标

- （1）资产托管业务经营管理合法合规；
- （2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；
- （3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；
- （4）提高资产托管经营效率和效果；
- （5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

2. 内部控制的原则

（1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。

（2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

（3）制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

（4）适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

（5）审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

（6）成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

3. 内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

（1）总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

（2）总行内控合规部负责托管业务的内控管理工作再监督，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中。

（3）总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

（4）一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

4. 内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在制度、流程、岗位、系统、授权审批、新机构、新客户、新业务及新产品、合同、印章、利益冲突、反洗钱、业务连续性等全方面执行内部控制措施。

5. 风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理与内部控制委员会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险、次生风险和道德风险。

6. 业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异地相结合的备份办公场所、必要的工作人员、科学清晰的AB岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异地异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金

资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十九、境外托管人

（一）境外资产托管人

名称：纽约梅隆银行股份有限公司（The Bank of New York Mellon Corporation）

注册地址：240 Greenwich Street, New York, New York 10286 USA

办公地址：240 Greenwich Street, New York, New York 10286 USA

法定代表人：Robin Vince (President & CEO - 主席兼首席执行官)

成立时间：1784 年

股东权益：395.35 亿美元（截止 2026 年 06 月 30 日）

托管和/或行政服务资产规模：62.6 万亿美元（截止 2026 年 06 月 30 日）

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

信用等级：Aa3 评级（穆迪），A（标普）（截止 2026 年 06 月 30 日）

纽约梅隆银行公司总部设在美国纽约 240 Greenwich Street，是美国历史最悠久的商业银行，也是全球最大的金融服务公司之一。公司集多元化及其配套业务于一体，服务内容包括资产管理、资产服务、发行人服务、清算服务、资金服务和财富管理。公司通过在全球 35 个国家和地区设立的分支机构，为超过 100 个金融市场的投资提供证券托管服务，为全球最大的托管行，并且是全球最大的资产管理服务提供商之一。公司在存托凭证、公司信托、股东服务、清算贸易、融资服务、佣金管理等业务方面都位居全球前列，并且是领先的美元现金管理、结算服务和全球支付服务供应公司。

截至 2026 年 06 月 30 日，纽约梅隆银行托管和/或行政服务资产规模达 62.6 万亿美元，管理资产规模为 2.2 万亿美元。

截至 2026 年 06 月 30 日，纽约梅隆银行股东权益为 395.35 亿美元，一级资本充足率为 11.00%。全球员工总人数约 46,500。

（二）境外托管人的职责

1. 安全保管受托财产；
2. 计算境外受托资产的资产净值；
3. 按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
4. 按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
5. 按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
6. 保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
7. 其他由基金托管人委托其履行的职责。

二十、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市丰台区丽泽路16号院4号楼汇亚大厦12层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	黄娜		

（2）嘉实基金管理有限公司网上直销

具体信息详见本公司网站（www.jsfund.cn）。

2、场外非直销销售机构

序号	销售机构名称	销售机构信息
1	中国工商银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号 住所：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：廖林 联系人：杨菲 客服电话：95588 网址： www.icbc.com.cn
2	中国农业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市东城区建国门内大街69号 住所：北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人：谷澍 联系人：林葛 电话：(010)85108227 传真：(010)85109219 客服电话：95599 网址： https://www.abchina.com/cn
3	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街1号 注册地址：北京市复兴门内大街1号 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：葛海蛟 联系人：梅非奇 电话：(010)66596688

		传真：(010)66594946 客服电话：95566 网址： http://www.boc.cn
4	交通银行股份有限公司	注册地址，办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 法定代表人：任德奇 联系人：高天 电话：021-58781234 传真：021-58408483 客服电话：95559 网址： www.bankcomm.com
5	招商银行股份有限公司	注册地址，办公地址：中国广东省深圳市福田区深南大道7088号 住所：中国广东省深圳市福田区深南大道7088号 法定代表人：缪建民 联系人：季平伟 电话：(0755) 83198888 传真：(0755) 83195050 客服电话：95555 网址： http://www.cmbchina.com
6	中信银行股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼中信大厦 注册地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 法定代表人：方合英 联系人：丰靖 电话：95558 客服电话：95558 网址： http://www.citicbank.com
7	上海浦东发展银行股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区博成路1306号B栋 注册地址：上海市中山东一路12号 住所：上海市中山东一路12号 法定代表人：张为忠 联系人：江逸舟、赵守良 电话：(021)61618888 传真：(021)63604199 客服电话：95528 网址： http://www.spdb.com.cn
8	兴业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：中国福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

		住所：中国福建省福州市台江区江滨中大道 398 号 兴业银行大厦 法定代表人：吕家进 联系人：卞晁煜 电话：(021) 52629999 传真：(021) 62569070 客服电话：95561 网址： http://www.cib.com.cn
9	中国光大银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 法定代表人：吴利军 联系人：朱红 电话：(010) 63636153 传真：010-63639709 客服电话：95595 网址： http://www.cebbank.com
10	中国民生银行股份有限公司	办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦 注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号 住所：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：高迎欣 联系人：王志刚 电话：(010)58560666 客服电话：95568 网址： http://www.cmbc.com.cn
11	中国邮政储蓄银行股份有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座 注册地址：北京市西城区金融大街 3 号 住所：北京市西城区金融大街 3 号 法定代表人：郑国雨 联系人：李雪萍 电话：95580 客服电话：95580 网址： www.psbc.com
12	华夏银行股份有限公司	办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 住所：北京市东城区建国门内大街 22 号 法定代表人：杨书剑 联系人：贾荣 客服电话：95577 网址： http://www.hxb.com.cn
13	上海银行股份有限公司	注册地址，办公地址：上海市黄浦区中山南路 688

		号 住所：上海市黄浦区中山南路 688 号 法定代表人：顾建忠 联系人：王笑 电话：021-68475888 传真：021-68476111 客服电话：95594 网址： http://www.bosc.cn
14	广发银行股份有限公司	注册地址，办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号 住所：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：林朝晖 联系人：詹全鑫、张扬眉 电话：(020) 38322256 传真：(020) 87310955 客服电话：400-830-8003 网址： http://www.cgbchina.com.cn
15	平安银行股份有限公司	办公地址：中国广东省深圳市深南东路 5047 号 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 联系人：张青 电话：0755-22166118 传真：0755-82080406 客服电话：95511-3 网址： http://www.bank.pingan.com
16	宁波银行股份有限公司	注册地址，办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 法定代表人：陆华裕 联系人：胡技勋 电话：(0574) 89068340 传真：(0574) 87050024 客服电话：95574 网址： http://www.nbcb.com.cn
17	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号 住所：上海市黄浦区中山东二路 70 号 法定代表人：徐力 联系人：施传荣 电话：021-38523692 传真：021-50105124 客服电话：(021)962999 网址： http://www.srcb.com

18	青岛银行股份有限公司	注册地址，办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路6号3号楼 住所：山东省青岛市崂山区秦岭路6号3号楼 法定代表人：景在伦 联系人：徐伟静 电话：0532-68629925 传真：0532-68629939 客服电话：96588(青岛)、4006696588(全国) 网址： http://www.qdccb.com/
19	浙商银行股份有限公司	办公地址：浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号 注册地址：中国浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号 住所：中国浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号 法定代表人：陈海强 联系人：谢冰然 电话：0571-88260386 客服电话：95527 网址： http://www.czbank.com
20	东莞银行股份有限公司	办公地址：东莞市莞城区体育路21号 注册地址：广东省东莞市莞城区体育路21号 住所：广东省东莞市莞城区体育路21号 法定代表人：卢国锋 联系人：朱杰霞 电话：0769-22111802 传真：0769-23156406 客服电话：956033 网址： https://www.dongguanbank.cn/
21	杭州银行股份有限公司	注册地址，办公地址：浙江省杭州市上城区解放东路168号 住所：浙江省杭州市上城区解放东路168号 法定代表人：宋剑斌 联系人：严峻 电话：(0571)85108309 传真：(0571)85108309 客服电话：95398 网址： http://www.hzbank.com.cn
22	温州银行股份有限公司	注册地址，办公地址：浙江省温州市鹿城区会展路1316号 住所：浙江省温州市鹿城区会展路1316号 法定代表人：陈宏强 联系人：蔡鹏 电话：0577-88997296 客服电话：0577-96699 网址： http://www.wzbank.cn

23	江苏银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省南京市中华路26号 住所：江苏省南京市中华路26号 法定代表人：夏平 联系人：张洪玮 电话：(025)58587036 传真：(025)58587820 客服电话：95319 网址： http://www.jsbchina.cn
24	乌鲁木齐银行股份有限公司	办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区新华北路8号 注册地址：新疆乌鲁木齐市水磨沟区会展大道599号新疆财富中心A座4层至31层 住所：新疆乌鲁木齐市水磨沟区会展大道599号新疆财富中心A座4层至31层 法定代表人：王辉 联系人：何佳 电话：(0991)8824667 传真：(0991)8824667 客服电话：(0991)96518 网址： http://www.uccb.com.cn
25	江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省常州市武进区延政中路9号 住所：江苏省常州市武进区延政中路9号 法定代表人：庄广强 联系人：李仙 电话：0519-89995161 客服电话：96005 网址： http://www.jnbank.com.cn
26	苏州银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省苏州工业园区钟园路728号 住所：江苏省苏州工业园区钟园路728号 法定代表人：崔庆军 联系人：熊志强 电话：0512-69868390 传真：0512-69868370 客服电话：0512-96067 网址： http://www.suzhoubank.com
27	天相投资顾问有限公司	办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 法定代表人：林义相 联系人：谭磊 电话：010-66045182

		传真：010-66045518 客服电话：010-66045678 网址：txsec.com
28	财咨道信息技术有限公司	注册地址，办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 住所：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 法定代表人：张斌 联系人：庞文静 电话：400-003-5811 客服电话：400-003-5811 网址：www.jinjiwo.com
29	上海陆享基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区滨江大道 1111 弄 1 号中企国际金融中心 A 楼 10 层 注册地址：上海市静安区武宁南路 203 号 4 楼南部 407 室 住所：上海市静安区武宁南路 203 号 4 楼南部 407 室 法定代表人：栗旭 联系人：张宇明、王玉、李佳 电话：021-53398968 客服电话：400-168-1235 网址：www.luxxfund.com
30	博时财富基金销售有限公司	办公地址：广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 法定代表人：杜松岭 联系人：崔丹 电话：0755-83169999 客服电话：4006105568 网址：www.boserawealth.com
31	诺亚正行基金销售有限公司	办公地址：上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心 A 栋 3 楼 注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层 住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层 法定代表人：王强 联系人：张裕 电话：021-38509735 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址：http://www.noah-fund.com

32	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室 住所：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址： http://www.zlfund.cn
33	上海好买基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区张杨路500号10楼 注册地址：上海市虹口区东大名路501号6211单元 住所：上海市虹口区东大名路501号6211单元 法定代表人：陶怡 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：4007009665 网址： https://www.howbuy.com/
34	上海长量基金销售有限公司	办公地址：上海浦东新区滨江大道1111弄1号中企国际金融中心A座6F 注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙烨 电话：021-20691869 传真：021-20691861 客服电话：400-089-1289 网址： http://www.erichfund.com
35	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼6层601内0615A 住所：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼6层601内0615A 法定代表人：闫振杰 联系人：李静如 电话：010-59601366-7024 客服电话：4008886661 网址： http://www.myfund.com
36	上海利得基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53层 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36室

		住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36室 法定代表人：李兴春 联系人：曹怡晨 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服电话：400-032-5885 网址：www.leadfund.com.cn
37	嘉实财富管理有限公司	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11层(100020) 注册地址：海南省三亚市吉阳区迎宾路198号的三亚太平金融产业港项目2号楼13层1315号房 住所：海南省三亚市吉阳区迎宾路198号的三亚太平金融产业港项目2号楼13层1315号房 法定代表人：经雷 联系人：闫欢 电话：400-021-8850 传真：-- 客服电话：400-021-8850 网址：http://www.harvestwm.cn
38	北京创金启富基金销售有限公司	注册地址，办公地址：北京市丰台区金泽路161号1号楼-4至43层101内3层09A 住所：北京市丰台区金泽路161号1号楼-4至43层101内3层09A 法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清 电话：010-66154828 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址：http://www.5irich.com
39	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号12层01D、02A—02F、03A—03C 住所：北京市朝阳区建国路乙118号12层01D、02A—02F、03A—03C 法定代表人：汤蕾 联系人：魏晨 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：400-6099-200 网址：http://www.yixinfund.com
40	浦领基金销售有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号16层1611 住所：北京市朝阳区建国路乙118号16层1611 法定代表人：张莲

		联系人：李艳 电话：010-59497361 传真：010-64788016 客服电话：400-012-5899 网址：www.zscffund.com
41	深圳腾元基金销售有限公司	注册地址，办公地址：深圳市前海深港合作区南山街道听海大道 5059 号前海鸿荣源中心 A 座 2404B 住所：深圳市前海深港合作区南山街道听海大道 5059 号前海鸿荣源中心 A 座 2404B 法定代表人：张帆 联系人：鄢萌莎 电话：0755-33376922 传真：0755-33065516 客服电话：4006877899 网址：http://www.tenyuanfund.com
42	北京汇成基金销售有限公司	办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层 注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 住所：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 法定代表人：王伟刚 联系人：宋子琪 电话：010-62680527 传真：010-62680527 客服电话：400-619-9059 网址：www.hcfunds.com
43	海银基金销售有限公司	办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 401 室 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室 法定代表人：孙亚超 联系人：秦琼 电话：021-80134149 传真：021-80133413 客服电话：4008081016 网址：http://www.fundhaiyin.com
44	北京广源达信基金销售有限公司	办公地址：北京市顺义区天祥路 6 号院,【北京东航中心】1 号楼 3 层 304B 注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室 住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

		法定代表人：齐剑辉 联系人：王英俊 电话：010-57298634 传真：010-82055860 客服电话：4006236060 网址：http://www.niuniufund.com
45	北京济安基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院冠捷大厦1105 注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼10层1005 住所：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼10层1005 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客服电话：400-673-7010 网址：http://www.jianfortune.com
46	上海联泰基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区溧阳路735号2幢3层 注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室 住所：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室 法定代表人：尹彬彬 联系人：兰敏 电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：400-118-1188 网址：www.66liantai.com
47	上海汇付基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宜山路700号C5栋 注册地址：上海市黄浦区九江路769号1807-3室 住所：上海市黄浦区九江路769号1807-3室 法定代表人：金佶 联系人：陈云卉 电话：021-33323998 传真：021-33323837 客服电话：400-820-2819 网址：www.hotjijin.com
48	泰信财富基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦1206 注册地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206 住所：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206 法定代表人：彭浩 联系人：孔安琪 电话：010-53579668

		客服电话：400-004-8821 网址：http://www.taixincf.com
49	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室 注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元 住所：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：4008-205-369 网址：http://www.jiyufund.com.cn
50	北京虹点基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区光华路5号院2号楼8层901内906单元 注册地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼19层2201内11室 住所：北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼19层2201内11室 法定代表人：邓伟 联系人：禹翠杰 电话：010-65868795 传真：- 客服电话：400-618-0707 网址：http://www.hongdianfund.com
51	深圳新华信通基金销售有限公司	办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦710、711室 注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道听海大道5059号前海鸿荣源中心A座2003B-2004C 住所：深圳市前海深港合作区南山街道听海大道5059号前海鸿荣源中心A座2003B-2004C 法定代表人：张宪琴 联系人：郭佶欣 电话：400-000-5767 客服电话：400-000-5767 网址：xintongfund.com
52	上海攀赢基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城路116号703室 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路116、128号7楼层（名义楼层，实际楼层6层）03室 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城路116、128号7楼层（名义楼层，实际楼层6层）03室 法定代表人：郑新林 联系人：邓琦

		电话：021-68889082 客服电话：021-68889082 网址：www.weonefunds.com
53	奕丰基金销售有限公司	办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 法定代表人：TEO WEE HOWE 联系人：叶健 电话：0755-89460500 传真：0755-21674453 客服电话：400-684-0500 网址：https://www.ifastps.com.cn/
54	大连网金基金销售有限公司	办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2F 注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 法定代表人：樊怀东 联系人：于舒 电话：0411-39027828 传真：0411-39027835 客服电话：4000-899-100 网址：http://www.yibaijin.com/
55	上海证达通基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区金葵路 118 号(云璟峰汇 G3 栋)3-B 区 注册地址：上海市浦东新区金葵路 118 号 3 层 B 区 住所：上海市浦东新区金葵路 118 号 3 层 B 区 法定代表人：姚杨 联系人：朱翔宇 电话：021-20538888 传真：021-20538999 客服电话：4008201515 网址：zhengtongfunds.com
56	上海中欧财富基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室 住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室 法定代表人：郑焰

		联系人：屠帅颖 电话：021-68609600 客服电话：400-700-9700 网址：https://www.zocaifu.com/
57	万家财富基金销售(天津)有限公司	办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号泓晟国际中心16层 注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 法定代表人：戴晓云 联系人：王茜蕊 电话：021-38909613 传真：010-59013828 客服电话：021-38909613 网址：http://www.wanjiawealth.com
58	上海华夏财富投资管理有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层 注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 法定代表人：毛淮平 联系人：仲秋玥 电话：010-88066632 传真：010-88066214 客服电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com
59	泉州银行股份有限公司	注册地址，办公地址：泉州市丰泽区泉泰路266号 住所：泉州市丰泽区泉泰路266号 法定代表人：江文鹏 联系人：董培姗、王燕玲 电话：0595-22551071 传真：0595-22578871 客服电话：4008896312 网址：http://www.qzccb.com/
60	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：95021 传真：(021) 64385308 客服电话：400-1818-188

		网址: http://www.1234567.com.cn
61	华源证券股份有限公司	办公地址: 湖北省武汉市江汉区万松街道青年路278号中海中心32F-34F 注册地址: 青海省西宁市南川工业园区创业路108号 住所: 青海省西宁市南川工业园区创业路108号 法定代表人: 邓晖 联系人: 张晔 电话: 95305-8 客服电话: 95305-8 网址: www.huayuanstock.com
62	北京雪球基金销售有限公司	办公地址: 北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层 注册地址: 北京市朝阳区创远路34号院6号楼19层1901内1903室 住所: 北京市朝阳区创远路34号院6号楼19层1901内1903室 法定代表人: 李楠 联系人: 吴迪 电话: 010-57319532 传真: 010-61840699 客服电话: 400-159-9288 网址: https://danjuanfunds.com/
63	中信期货有限公司	办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1303-1305室、14层 注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层 住所: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层 法定代表人: 王小果(代) 联系人: 梁美娜 传真: 021-60819988 客服电话: 400-990-8826 网址: http://www.citicsf.com/
64	东海期货有限责任公司	办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号8楼 注册地址: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号 住所: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号 法定代表人: 陈太康 联系人: 戴文楠 电话: 021-68751603 传真: 021-68756991 客服电话: 95531/4008888588 网址: http://www.qh168.com.cn

65	国泰海通证券股份有限公司	办公地址：上海市静安区南京西路 768 号 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 法定代表人：朱健 联系人：黄博铭 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：95521 网址：www.gtht.com
66	中信建投证券股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 法定代表人：刘成 联系人：谢欣然 电话：010-86451810 客服电话：(8610)65608107 网址：http://www.csc108.com
67	国信证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 注册地址：广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 住所：广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：张纳沙 联系人：李颖 电话：0755-81682519 客服电话：95536 网址：http://www.guosen.com.cn
68	招商证券股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 法定代表人：朱江涛 联系人：业清扬 电话：0755-82943666 传真：0755-83734343 客服电话：95565 网址：http://www.cmschina.com
69	广发证券股份有限公司	办公地址：广东省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 住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

		法定代表人：林传辉 联系人：陈姗姗 电话：（020）66338888 客服电话：95575 或致电各地营业网点 网址：http://www.gf.com.cn
70	中信证券股份有限公司	办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 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 住所：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：王一通 电话：010-60838888 客服电话：95548 网址：http://www.citics.com
71	中国银河证券股份有限公司	办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦 注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101 住所：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101 法定代表人：王晟 联系人：辛国政 客服电话：4008-888-888 或 95551 网址：https://www.chinastock.com.cn
72	申万宏源证券有限公司	注册地址，办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 住所：上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人：张剑 联系人：王昊洋 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：http://www.swhysc.com
73	兴业证券股份有限公司	注册地址，办公地址：福建省福州市湖东路268号 住所：福建省福州市湖东路268号 法定代表人：苏军良 联系人：乔琳雪 电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：http://www.xyzq.com.cn
74	长江证券股份有限公司	注册地址，办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路

		88号 住所：湖北省武汉市江汉区淮海路88号 法定代表人：刘正斌 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：95579 或 4008-888-999 网址：http://www.95579.com
75	国投证券股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦 住所：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦 法定代表人：王苏望 联系人：彭洁联 电话：0755-81682531 客服电话：95517 网址：www.sdicsc.com.cn
76	西南证券股份有限公司	注册地址，办公地址：重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼 住所：重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼 法定代表人：姜栋林 联系人：冉绪 电话：023-63786145 客服电话：95355 网址：http://www.swsc.com.cn
77	湘财证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼 住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼 法定代表人：高振营 联系人：江恩前 电话：(021)38784580 客服电话：95351 网址：http://www.xcsc.com
78	万联证券股份有限公司	办公地址：广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层 注册地址：广东省广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层 住所：广东省广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层 法定代表人：王达

		联系人：丁思 电话：020-83988334 客服电话：95322 网址：http://www.wlzq.cn
79	民生证券股份有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号 住所：中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号 法定代表人：顾伟 联系人：刘玥/曹宇鑫 电话：021-80508592/021-80508504 客服电话：021-80508866;021-80508332 网址：http://www.msza.com
80	国元证券股份有限公司	注册地址，办公地址：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座 住所：安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座 法定代表人：沈和付 联系人：汪先哲 电话：0551-62207400 传真：0551-62207148 客服电话：95578 网址：www.gyzq.com.cn
81	渤海证券股份有限公司	办公地址：天津市南开区滨水西道8号 注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 法定代表人：安志勇 联系人：王星 电话：022-28451922 客服电话：956066 网址：http://www.ewww.com.cn/
82	华泰证券股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省南京市江东中路228号华泰证券广场 住所：江苏省南京市江东中路228号华泰证券广场 法定代表人：王会清 联系人：郭力铭 电话：18936886079 客服电话：95597 网址：http://www.htsc.com.cn/
83	山西证券股份有限公司	注册地址，办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

		法定代表人：王怡里 联系人：郭熠 电话：（0351）8686659 传真：（0351）8686619 客服电话：95573 网址：http://www.sxzq.net/shouye/index.shtml
84	中信证券（山东）有限责任公司	办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座 注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 法定代表人：肖海峰 联系人：赵如意 电话：0532-85725062 客服电话：95548 网址：http://sd.citics.com
85	东吴证券股份有限公司	办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦 注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号 住所：江苏省苏州市工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 联系人：陆晓 电话：0512-52938521 传真：0512-62938527 客服电话：95330 网址：http://www.dwzq.com.cn
86	信达证券股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号1幢5层 住所：北京市西城区宣武门西大街甲127号1幢5层 法定代表人：林志忠 联系人：付婷 客服电话：95321 网址：http://www.cindasc.com/
87	东方证券股份有限公司	办公地址：中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层 注册地址：上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦 住所：上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦 法定代表人：周磊 联系人：龚玉君、闻鑫 客服电话：021-6332 5888 网址：http://www.dfzq.com.cn

88	方正证券股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座17层 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 住所：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 客服电话：95571 网址： http://www.foundersc.com
89	长城证券股份有限公司	注册地址，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 住所：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：王军 联系人：陈静 电话：0755-8355761 客服电话：95514 网址： http://www.cgws.com/cczq
90	光大证券股份有限公司	注册地址，办公地址：上海市静安区新闸路1508号 住所：上海市静安区新闸路1508号 法定代表人：刘秋明 联系人：郁疆 客服电话：95525 网址： http://www.ebscn.com
91	中信证券华南股份有限公司	注册地址，办公地址：广州市天河区临江大道395号901室1001室 住所：广州市天河区临江大道395号901室1001室 法定代表人：陈可可 联系人：郭杏燕 电话：020-88834787 客服电话：95548 网址： http://www.gzs.com.cn
92	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 住所：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：021-20361166 客服电话：95360 网址： http://www.nesc.cn
93	南京证券股份有限公司	办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路389号

		注册地址：江苏省南京市江东中路 389 号 住所：江苏省南京市江东中路 389 号 法定代表人：夏宏建 联系人：曹梦媛 电话：025-58519529 客服电话：95386 网址： http://www.njzq.com.cn
94	上海证券有限责任公司	注册地址，办公地址：上海市黄浦区人民路 366 号 住所：上海市黄浦区人民路 366 号 法定代表人：李海超 联系人：邵珍珍 电话：(021)53686888 传真：(021)53686100-7008 客服电话：4008918918 网址： http://www.shzq.com
95	诚通证券股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层 住所：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层 法定代表人：张威 联系人：廖晓 电话：010-83561321 客服电话：95399 网址： www.cctgsc.com.cn
96	大同证券有限责任公司	办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层 注册地址：山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 住所：山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 法定代表人：董祥 联系人：纪肖峰 电话：0351-7219280 传真：0351-4137986 客服电话：4007121212 网址： http://www.dtsbc.com.cn
97	国联民生证券股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省无锡市金融一街 8 号 住所：江苏省无锡市金融一街 8 号 法定代表人：顾伟 联系人：庞芝慧 电话：15006172037 客服电话：95570 网址： http://www.glms.com.cn
98	平安证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层

		注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 住所：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 法定代表人：何之江 联系人：尹杭婷 传真：021-58991896 客服电话：95511-8 网址：http://www.stock.pingan.com
99	华安证券股份有限公司	注册地址，办公地址：安徽省合肥市滨湖新区紫云路 1018 号 住所：安徽省合肥市滨湖新区紫云路 1018 号 法定代表人：章宏韬 联系人：范超 电话：0551-65161821 传真：0551-65161672 客服电话：95318 网址：http://www.hazq.com
100	财信证券股份有限公司	办公地址：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋（B 座）21 层 注册地址：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋（B 座）26 层 住所：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋（B 座）26 层 法定代表人：刘宛晨 联系人：郭静 电话：(0731)84403347 客服电话：95317 网址：https://stock.hnchasing.com
101	东莞证券股份有限公司	办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号 住所：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号 法定代表人：潘海标 联系人：梁微 电话：0769-22115712 客服电话：95328 网址：http://www.dgzq.com.cn/
102	中原证券股份有限公司	注册地址，办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号 住所：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号 法定代表人：张秋云 联系人：李盼盼 电话：0371--69099882

		客服电话：95377 网址：http://www.ccnew.com
103	国都证券股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市东城区东直门外斜街9号院2号楼16层北塔1601-03、17层北塔1701、18层北塔1801、19层北塔1901 住所：北京市东城区东直门外斜街9号院2号楼16层北塔1601-03、17层北塔1701、18层北塔1801、19层北塔1901 法定代表人：张晖 联系人：张晖 电话：010-87413731 客服电话：400-818-8118 网址：http://www.guodu.com
104	东海证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 法定代表人：王文卓 联系人：王一彦 电话：(021)20333333 传真：021-50498825 客服电话：95531;400-8888-588 网址：http://www.longone.com.cn
105	中银国际证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39、40、41层、北京市西城区西单北大街110号7层 注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层 法定代表人：周权 联系人：初晓 电话：021-20328755 传真：021-58883554 客服电话：4006208888 网址：http://www.bocichina.com
106	金融街证券股份有限公司	办公地址：中国内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 法定代表人：祝艳辉

		联系人：熊丽、王捷勋 电话：0471-4972675 客服电话：956088 网址：http://www.jrjq.com.cn
107	国盛证券股份有限公司	办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼 注册地址：江西省南昌市新建区子实路1589号 住所：江西省南昌市新建区子实路1589号 法定代表人：刘朝东 联系人：占文驰 电话：0791-88250812 客服电话：956080 网址：https://www.gsyzq.com/
108	华西证券股份有限公司	注册地址，办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：赵静静 电话：010-58124967 客服电话：028-86150207 网址：http://www.hx168.com.cn
109	申万宏源西部证券有限公司	注册地址，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 住所：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：王献军 联系人：王昊洋 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
110	中泰证券股份有限公司	办公地址：济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼 注册地址：山东省济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼 住所：山东省济南市高新区经十路7000号汉峪金融商务中心五区3号楼 法定代表人：王洪 联系人：张峰源 电话：021-20315719 客服电话：95538 网址：http://www.zts.com.cn
111	世纪证券有限责任公司	办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路

		2026 号能源大厦北塔 23-25 层 注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5073 号民生互联网大厦 C 座 1401-1408、1501-1508、1601-1606、1701-1705 住所：深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5073 号民生互联网大厦 C 座 1401-1408、1501-1508、1601-1606、1701-1705 法定代表人：李剑峰 联系人：徐玲娟 电话：0755-83199599-8201 客服电话：956019 网址：http://www.csc.com.cn
112	第一创业证券股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 法定代表人：郭川 联系人：王雯 电话：0755-23838752 客服电话：95358 网址：http://www.firstcapital.com.cn
113	金元证券股份有限公司	注册地址，办公地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼 住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼 法定代表人：陆涛 联系人：唐乙丹 客服电话：400-8888-228 网址：http://www.jyzq.cn
114	中航证券有限公司	办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航产融大厦 35 层 注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层 住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层 法定代表人：戚侠 联系人：孙健 客服电话：95335 网址：http://avicsec.com/main/home/index.shtml
115	德邦证券股份有限公司	办公地址：上海市黄浦区中山东二路 600 号外滩金融中心 S2 幢 22 楼 注册地址：山东省济南市历下区姚家街道山左路 1851 号山东财金大厦 9 层 901-910 室 住所：山东省济南市历下区姚家街道山左路 1851 号山东财金大厦 9 层 901-910 室

		法定代表人：梁雷 联系人：张卉娟 电话：(021) 68761616 客服电话：4008888128 网址：http://www.tebon.com.cn
116	西部证券股份有限公司	注册地址，办公地址：陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室 住所：陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室 法定代表人：徐朝晖 联系人：梁承华 电话：(029)87416168 传真：(029)87406710 客服电话：95582 网址：https://www.westsecu.com
117	华福证券有限责任公司	办公地址：福州市台江区江滨中大道380号宝地广场18-19层 注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层 住所：福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层 法定代表人：黄德良 联系人：林秋红 客服电话：95547 网址：http://www.hfzq.com.cn
118	华龙证券股份有限公司	办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心19楼 注册地址：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼 住所：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼 法定代表人：王锡真 联系人：周鑫 电话：0931-4890208 客服电话：95368 网址：http://www.hlzq.com/
119	中国国际金融股份有限公司	注册地址，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 住所：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：陈亮 联系人：中金公司股票业务部 传真：010-65058065 客服电话：4008209068

		网址: http://www.cicc.com.cn
120	甬兴证券有限公司	办公地址: 上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 31、32 层 注册地址: 浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层 住所: 浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层 法定代表人: 李抱 联系人: 苏晓杰 电话: 13917829777 客服电话: 400-916-0666 网址: https://www.yongxingsec.com
121	五矿证券有限公司	办公地址: 深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦 (18-25 层) 注册地址: 深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401 住所: 深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401 法定代表人: 郑宇 联系人: 赵晓棋 电话: 0755-23375447 客服电话: 40018-40028 网址: http://www.wkzq.com.cn
122	华鑫证券有限责任公司	办公地址: 上海市徐汇区云锦路 277 号西岸数字股二期 T3 注册地址: 深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 住所: 深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 法定代表人: 俞洋 联系人: 刘熠 电话: 021-64339000 客服电话: 95323, 4001099918 (全国) 网址: http://www.cfsc.com.cn
123	中国中金财富证券有限公司	办公地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 20 层 注册地址: 深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608 住所: 深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608 法定代表人: 王建力 联系人: 陈梓基 客服电话: 95532 网址: https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/

124	中山证券有限责任公司	注册地址，办公地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区芳芷一路13号舜远金融大厦1栋23层 住所：深圳市南山区粤海街道海珠社区芳芷一路13号舜远金融大厦1栋23层 法定代表人：李永湖 联系人：罗艺琳 客服电话：95329 网址：www.zszq.com
125	东方财富证券股份有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼 住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼 法定代表人：戴彦 联系人：陈亚男 电话：021-23586583 传真：021-23586789 客服电话：95357 网址：http://www.18.cn
126	国融证券股份有限公司	办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层 注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼 住所：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼 法定代表人：黄斌 联系人：胡俊珂 电话：83991462 客服电话：95385 网址：http://www.grzq.com
127	粤开证券股份有限公司	办公地址：广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、22、23层 注册地址：广东省广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、22、23层 住所：广东省广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、22、23层 法定代表人：郭川舟 联系人：彭莲 电话：0755-83331195 客服电话：95564 网址：http://www.ykzq.com/
128	江海证券有限公司	办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号 注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

		住所：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 法定代表人：赵洪波 联系人：周俊 客服电话：956007 网址： http://www.jhzq.com.cn/
129	国金证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号 7 楼 注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 住所：成都市青羊区东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 联系人：郭元媛 电话：15690849268 客服电话：95310 网址： http://www.gjzq.com.cn
130	华宝证券股份有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 住所：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 法定代表人：刘加海 联系人：夏元 电话：(021) 68777222 传真：(021) 68777822 客服电话：4008209898 网址： http://www.cnhbstock.com
131	长城国瑞证券有限公司	注册地址，办公地址：厦门市思明区台北路 1 号海西金谷广场 T2 办公楼 13-14 层 住所：厦门市思明区台北路 1 号海西金谷广场 T2 办公楼 13-14 层 法定代表人：李鹏 联系人：陈月月 电话：0592-2079658 传真：0592-5162590 客服电话：400-0099-886 网址： http://www.gwgsc.com
132	爱建证券有限责任公司	办公地址：上海市浦东新区前滩大道 199 弄 5 号 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼 法定代表人：江伟 联系人：赵婧玥 电话：021-32229888-25129 客服电话：4001962502 网址： http://www.ajzq.com
133	国新证券股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号

		注册地址：北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室 住所：北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室 法定代表人：张海文 联系人：孙燕波 电话：010-85556048 传真：010-85556088 客服电话：400-898-4999 网址：https://crhcweb.crsec.com.cn/
134	财达证券股份有限公司	注册地址，办公地址：河北省石家庄市桥西区胜利南大街87号兴石广场1号楼20层、22层至32层 住所：河北省石家庄市桥西区胜利南大街87号兴石广场1号楼20层、22层至32层 法定代表人：张明 联系人：高晨婧 电话：0311-86273151 客服电话：河北省内:95363;河北省外:0311-95363 网址：https://www.95363.com/
135	天风证券股份有限公司	办公地址：湖北省武汉市武昌区中北路217号天风大厦2号楼25层 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层 住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层 法定代表人：庞介民 联系人：诸培宁 电话：027-87618867 传真：027-87618863 客服电话：95391;4008005000 网址：http://www.tfzq.com
136	万和证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦20层西厅 注册地址：海口市南沙路49号通信广场二楼 住所：海口市南沙路49号通信广场二楼 法定代表人：甘卫斌 联系人：张雷 电话：0755-82830333 传真：0755-25170093 客服电话：4008-882-882 网址：http://www.vanho.cn/
137	天府证券有限责任公司	注册地址，办公地址：成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 住所：成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

		法定代表人：吴玉明 联系人：刘梅丽 客服电话：95304 网址：http://www.tianfuzq.cn
138	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	办公地址：北京市丰台区丽泽平安幸福中心 B 座 31 层 注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 住所：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 法定代表人：张斌 联系人：孙博文 电话：010-83363002 传真：010-83363072 客服电话：400-166-1188-2 网址：http://www.new-rand.cn
139	和讯信息科技有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层 注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 法定代表人：罗佳 联系人：陈慧慧 电话：010-85657353 传真：8610-65884788 客服电话：4009200022 网址：http://licaike.hexun.com/
140	上海挖财基金销售有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区锦康路 258 号第 10 层(实际楼层第 9 层)02A 单元 住所：中国(上海)自由贸易试验区锦康路 258 号第 10 层(实际楼层第 9 层)02A 单元 法定代表人：方磊 联系人：毛善波 电话：021-50810687 传真：021-58300279 客服电话：021-50810673 网址：http://www.wacaijijin.com
141	贵州省贵文文化基金销售有限公司	注册地址，办公地址：贵州省贵阳市贵州双龙航空港经济区小碧布依族苗族乡兴业西路 CCDI 项目工作基地 1 层 住所：贵州省贵阳市贵州双龙航空港经济区小碧布依族苗族乡兴业西路 CCDI 项目工作基地 1 层 法定代表人：陈成 联系人：唐宜为 电话：18616726630

		客服电话：0851-85407888 网址：http://www.gwcaifu.com
142	腾安基金销售(深圳)有限公司	办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：谭广锋 联系人：谭广锋 电话：0755-86013388-80618 传真：- 客服电话：95017 网址：http://www.tenganxinxi.com 或 http://www.txfund.com
143	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 法定代表人：盛超 联系人：林天赐 电话：010-59403028 传真：010-59403027 客服电话：95055 网址：http://www.duxiaomanfund.com
144	易方达财富管理基金销售(广州)有限公司	办公地址：广州市天河区广州银行大厦 40 楼 注册地址：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房 住所：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房 法定代表人：陈彤 联系人：吕晋 电话：020-85102688-7498 客服电话：4001608888 网址：www.efundcf.com.cn
145	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 569 号间 9 号楼小邮局 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 法定代表人：王珺 联系人：韩爱彬

		电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客服电话：95188-8 网址：www.antfortune.com
146	浙江同花顺基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大厦 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号401室 住所：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号401室 法定代表人：吴强 联系人：林海明 电话：0571-88920897 传真：0571-86800423 客服电话：952555 网址：http://www.5ifund.com
147	泛华普益基金销售有限公司	办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室 注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室 住所：成都市成华区建设路9号高地中心1101室 法定代表人：王建华 联系人：史若芬 电话：028-86645380 传真：028-82000996-805 客服电话：400-080-3388 网址：https://www.puyifund.com
148	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址，办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：钱燕飞 联系人：冯鹏鹏 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699-887226 客服电话：95177 网址：http://www.snjijin.com/
149	上海大智慧基金销售有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区东方路1217号、1217-1号6幢第21层(名义楼层,实际楼层第19层)05单元 住所：中国(上海)自由贸易试验区东方路1217号、1217-1号6幢第21层(名义楼层,实际楼层第19层)05单元 法定代表人：张俊 联系人：张蜓

		电话：021-20219988-37492 传真：021-20219923 客服电话：021-20292031 网址： https://www.wg.com.cn/
150	北京新浪仓石基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区中关村软件园二期新浪总部科研楼 注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 法定代表人：李柳娜 联系人：邵文静 电话：010-62675768 传真：010-62676582 客服电话：010-6267 5369 网址： www.xincai.com
151	上海万得基金销售有限公司	办公地址：上海市浦明路 1500 号万得大厦 7 楼 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座 住所：中国(上海)自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座 法定代表人：简梦雯 联系人：徐亚丹 电话：021-68882280 传真：021-68882281 客服电话：400-799-1888 网址： https://www.520fund.com.cn/
152	上海陆金所基金销售有限公司	办公地址：中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层(实际楼层 6 层) 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层） 住所：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层） 法定代表人：陈祎彬 联系人：汤艳丽 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址： http://www.lufunds.com
153	珠海盈米基金销售有限公司	办公地址：珠海市横琴新区琴朗道 91 号 1608、1609、1610 办公 注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

		住所：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘 电话：020-89629019 传真：020-89629011 客服电话：020-89629099 网址： http://www.yingmi.com
154	和耕传承基金销售有限公司	注册地址，办公地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)普惠路 55 号 1 号楼 9 层 30-910 住所：河南自贸试验区郑州片区(郑东)普惠路 55 号 1 号楼 9 层 30-910 法定代表人：温丽燕 联系人：高培 电话：0371-85518395 传真：0371-85518397 客服电话：4000-555-671 网址： https://www.hgccpb.com/
155	京东肯特瑞基金销售有限公司	办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层 注册地址：北京市海淀区知春路 76 号（写字楼）1 号楼 4 层 1-7-2 住所：北京市海淀区知春路 76 号（写字楼）1 号楼 4 层 1-7-2 法定代表人：王珊珊 联系人：李丹 电话：4000988511 传真：010-89188000 客服电话：010-89187658 网址： kenterui.jd.com
156	深圳市排排网基金销售有限责任公司	办公地址：深圳市福田区沙嘴路尚美红树湾 1 号 A 座写字楼 16 楼 注册地址：深圳市福田区沙头街道沙嘴社区沙嘴路 8 号红树华府 A 栋 1601 住所：深圳市福田区沙头街道沙嘴社区沙嘴路 8 号红树华府 A 栋 1601 法定代表人：杨柳 联系人：周圆圆 电话：400-666-7388 传真：400-666-7388 客服电话：400-666-7388 网址： ppwfund.com
157	华瑞保险销售有限公司	办公地址：上海市嘉定区众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层 注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通

		星财富广场1号楼B座14层 住所：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座14层 法定代表人：王树科 联系人：张爽爽 电话：021-68595976 传真：021-68595766 客服电话：952303 网址： http://www.huaruisales.com
158	玄元保险代理有限公司	办公地址：上海市嘉定区银翔路799号506-2 注册地址：上海市黄浦区广东路500号15层(实际楼层11楼)04室 住所：上海市黄浦区广东路500号15层(实际楼层11楼)04室 法定代表人：马永谔 联系人：姜帅伯 电话：021-50701003 传真：021-50701053 客服电话：021-50701003 网址： www.licaimofang.com
159	深圳前海微众银行股份有限公司	办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：顾敏 联系人：邹榆 电话：95384 传真：0755-86700688 客服电话：95384 网址： https://www.webank.com/

3、场内非直销销售机构

指具有基金代销业务资格的证券经营机构营业部（指具有中国证监会认可的证券经营资格，经深交所审核批准后成为其会员，依法在交易所内进行证券买卖的交易所会员营业部），具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

（二）登记机构

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）律师事务所和经办律师

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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26		
办公地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26		
执行事务合伙人	肖厚发、刘维	联系人	蔡晓慧
电话	010-66001391	传真	010-66001392
经办注册会计师	蔡晓慧、柴瀚英		

二十一、基金合同的内容摘要

一）、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1） 分享基金财产收益；
- （2） 参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3） 依法转让、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、召开基金份额持有人大会；
- （5） 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6） 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7） 监督基金管理人的投资运作；
- （8） 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- （1） 遵守《基金合同》；
- （2） 提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时更新和补充，并保证其真实性；
- （3） 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （4） 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （5） 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （6） 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、其他基金份额持有人及基金非直销销售机构处获得的不当得利；
- （7） 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （8） 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

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

- （1） 依法募集基金；
- （2） 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3） 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4） 销售基金份额；
- （5） 召集基金份额持有人大会；
- （6） 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7） 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8） 选择、委托、更换基金非直销销售机构，对基金非直销销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9） 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10） 依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11） 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12） 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- （13） 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；
- （14） 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
- （15） 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （16） 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；
- （17） 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
- （18） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- （1） 依法募集基金，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；如认为基金非直销销售机构违反《基金合同》、基金销售

与服务代理协议及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

- （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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- （6） 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- （7） 依法接受基金托管人的监督；
- （8） 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- （9） 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- （10） 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- （11） 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- （12） 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- （13） 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- （14） 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- （15） 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- （16） 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
- （17） 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- （18） 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（22） 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

（24） 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25） 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26） 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

（27） 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

（4） 选择、更换或撤销境外托管人；

（5） 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（6） 提议召开或召集基金份额持有人大会；

（7） 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（8） 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- （1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- （2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- （3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人固有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- （4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照有关法律法规和《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- （7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- （8）确保基金份额净值按照有关法律法规、基金合同规定的方法进行计算，复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- （9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- （10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- （11）根据法律法规规定的年限保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- （12）建立并保存基金份额持有人名册；
- （13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- （14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- （15）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；
- （16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- （17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- （19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

（21） 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22） 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人承担相应赔偿或追索责任；在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议的适用法律及当地的证券市场惯例决定；

（23） 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

（24） 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（25） 每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

（26） 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务。

（27） 根据法律法规规定的年限保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料；

（28） 法律法规、《基金合同》规定的其他义务以及中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的基金托管人的其他职责。

二）、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》，但在基金规模低于5000万元的情况下除外；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人和基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费和基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整相关业务规则；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票结果。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于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。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关

对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

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

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。

基金份额持有人大会决议应自在生效的次日依照《信息披露办法》的有关规定，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

三）、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，对于场外认购、申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

四）、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（二）基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.26%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.26\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

五）、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对国际市场黄金价格走势的有效跟踪。

（二）投资范围

本基金主要投资于全球证券市场上依法可投资的公募基金（包括ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金的投资组合比例范围：在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的 80%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。黄金基金指黄金 ETF、黄金股票指数 ETF 以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金 ETF 外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的 ETF，以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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

（三）投资限制

下列投资限制为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关限制性规定，如法律法规或监管部门取消下列限制性或禁止性规定，本基金履行适当程序后可以不受下列限制。

1. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）购买不动产；
- （5）购买房地产抵押按揭；
- （6）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （7）购买实物商品；
- （8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- （9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （10）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- （12）直接投资与实物商品相关的衍生品；

(13) 向基金管理人、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债券；

(14) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；

(15) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(16) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

2. 投资组合限制

本基金的投资将遵循以下限制：

(1) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2) 基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(3) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

(4) 基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本公司管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(5) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(6) 本公司管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

(7) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

(8) 每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金投资境外伞形基金的，该伞形基金应当视为一只基金。

(9) 本基金不得投资于以下基金：

(a) 其他基金中基金；

(b) 联接基金（A Feeder Fund）；

(c) 投资于前述两项基金的伞形基金子基金。

(10) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使

基金投资不符合上述各项投资比例限制的，基金管理人应当在三十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。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，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。

3. 金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

- （1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。
- （2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。
- （3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
 - ①所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。
 - ②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。
 - ③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。
 - ④基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

4. 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

- （1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。
- （2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。
- （3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
- （4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：
 - ①现金；
 - ②存款证明；
 - ③商业票据；
 - ④政府债券；
 - ⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

（7）基金参与证券借贷交易，所有已借出而未归还证券总市值不得超过基金总资产的50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。

5. 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。本项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

《基金法》、《试行办法》、《通知》及其他有关法律法规或监管部门取消第（三）至（六）项投资限制的，履行适当程序后，本基金不受上述限制。

六）、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次2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。

七）、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）终止《基金合同》，但在基金规模低于5000万元的情况下除外；

- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整相关业务规则；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应按照届时有效的法律法规报经中国证监会核准或备案，自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、若基金规模低于5000万元，基金管理人有权在不召开基金份额持有人大会的情况下终止基金合同；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月，自基金财产清算小组成立之日起算。

八）、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九）、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金非直销销售机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

二十二、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

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：住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元

法定代表人：经雷

成立时间：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]5号

注册资本：1.5亿元

组织形式：有限责任公司（外商投资、非独资）

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

电话：（010）6521 5588

传真：（010）6518 5678

联系人：胡勇钦

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：廖林

电话：（010）66106720

传真：（010）66106904

联系人：郭明

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险-代理业务-；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管

理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（A）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于全球证券市场上依法可投资的公募基金（包括ETF）、固定收益债券、货币市场工具、及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。此外，本基金为对冲汇率风险，可以投资于外汇远期合约、外汇互换协议、利率期权等金融工具。

本基金的投资组合比例范围：在拟投资对象资产数量和资产规模允许的条件下，投资于跟踪黄金价格或黄金价格指数的公募基金的比例不低于本基金资产净值的80%，其中投资于有实物黄金支持的（Backed by physical gold）交易所交易基金的比例不低于上述黄金基金投资资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于本基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。黄金基金指黄金ETF、黄金股票指数ETF以及其他跟踪黄金价格或者黄金价格指数的非上市黄金公募基金。

在保证流动性的前提下，本基金现金头寸可存放于境内，满足基金赎回、支付管理费、托管费、手续费等需要，并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具（包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF，以及在国内外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等），基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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

本基金不得投资于相关法律法规及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

在正常的市场状况下，本基金至少将基金资产的90%投资于跟踪黄金价格的交易所交易基金（ETF）其他公募基金等以黄金价格为投资标的的金融工具，其中本基金将以有实物黄金支持（Physical gold underlying）的黄金ETF或黄金型公募基金为主；现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

① 本基金持有同一银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

② 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的10%。

③ 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

④ 在本托管人托管下的基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。基金管理人管理的且托管在基金托管人处的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。上述投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

⑤ 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%。上述非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

⑥ 在本托管人托管下的基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的20%。

⑦ 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

⑧ 每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外伞形基金的，该伞形基金应当视为一只基金。

⑨ 本基金不得投资于以下基金：

1. 其他基金中基金；

2. 联接基金（A Feeder Fund）；
3. 投资于前述两项基金的伞形基金子基金。

⑩ 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

若基金超过上述 1-9 项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求

？ 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

A. 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

B. 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

C. 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

D. 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

- a. 现金；
- b. 存款证明；
- c. 商业票据；
- d. 政府债券；

e. 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

E. 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

F. 基金参与证券借贷交易，所有已借出而未归还证券总市值不得超过基金总资产的 50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。

？ 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

A. 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

B. 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

C. 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

D. 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

？ 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。

上述比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

（3）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《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》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- a) 承销证券；
- b) 向他人贷款或提供担保；
- c) 从事承担无限责任的投资；
- d) 购买不动产；
- e) 购买房地产抵押按揭；
- f) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- g) 购买实物商品；
- h) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- i) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- j) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- k) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- l) 向基金管理人、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债券；
- m) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- n) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- o) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金投资银行存款的，其基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。本基金投资除提供的存款银行名单以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于存款银行名单进行调整。

（B）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、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。

（C）基金托管人发现基金管理人的投资运作和投资指令违反法律法规或《基金合同》的规定，应及时以书面或电话或双方认可的其他方式通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人应报告监管部门。

基金托管人发现基金管理人或其授权投资机构有重大违法违规行为，应立即报告有关监管机构，同时通知基金管理人；由基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告有关监管机构。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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. 在本协议有效期内，在不违反公平、合理原则，以及不导致基金托管人的接受基金管理人监督与检查与相关法律法规及其行业监管要求相冲突的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的监督与检查。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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人须向基金托管人作出书面提示；基金托管人在接到提示后，应立即对提示内容予以确认，如无异议，应在基金管理人给定的合理期限内改进，如有异议，应作出书面解释。

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

（四）基金财产保管

（A）基金财产保管的原则

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

基金托管人应安全保管基金财产；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；

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；

除依据有关法律法规规定和本协议约定外，基金托管人、及其境外托管人不得利用基金财产为自己或第三方谋取利益，违反此义务所得利益归于基金财产，由此造成的直接损失由基金托管人承担，该等责任包括但不限于恢复基金财产的原状、承担因此所引起的直接损失的赔偿责任；

基金托管人自身，并尽商业上的一切努力确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；

除非根据基金管理人书面同意，基金托管人和境外托管人不得在任何托管资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等；

对于因为基金管理人进行本协议项下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。到账日没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知并配合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。

（B）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。

2、验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

（C）资产保管内容和约定事项

基金管理人同意，现金账户中的现金将由基金托管人或其境外托管人以基金托管人或其境外托管人的银行身份持有。

除非授权人士按指令程序发送的指令另有规定，否则，基金托管人和其境外托管人应在收到授权人士的指令后，按下述方式支付现金、售出或交付证券：(a)按照交易发生的司法管辖区或市场的有关惯常和既定惯例和程序作出；或(b)就通过证券系统进行的买卖而言，按照管辖该系统运营的规则、条例和条件作出。基金托管人和其境外托管人应不时将该等有关惯例、程序、规则、条例和条件及时通知基金管理人。

基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将基金财产归入其清算财产，境外托管人所在地法律或监管机构另有规定的除外。

基金托管人应自身，并确保其境外托管人尽商业的合理努力建立安全的数据管理机制，安全完整地保存基金管理人与基金财产相关的业务数据和信息。

（D）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金、基金托管人或其境外托管人的名义在其营业机构或其境外托管人开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金的银行预留印鉴由基金托管人或其境外托管人的营业机构保管和使用。

2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借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基金业务以外的活动。

3、基金资金账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区相关监管机构的有关规定。

（E）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在基金所投资市场或证券交易所适用的登记结算机构为基金开立基金托管人或其境外托管人名义或基金托管人与基金联名的证券账户。由基金托管人或其境外托管人负责办理与开立证券账户有关的手续。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自境外托管人均不得出借或未经基金托管人、基金管理人双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基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件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、基金管理人投资于合法合规、符合基金合同的其他非交易所市场的投资品种时，在基金合同生效后，基金托管人或其境外托管人根据投资所在市场以及国家或地区的相关规定，开立进行基金的投资活动所需要的各类证券和结算账户。

5、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区有关法律的规定。

（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，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或其境外托管人负责开立。

2、投资市场所在国家或地区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）证券登记

1、境外证券的注册登记方式应符合投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例。

2、基金托管人应确保基金管理人所管理的基金或基金份额持有人始终是所有证券的实益所有人(beneficial owner)的方式持有基金财产中的所有证券。

3、基金托管人应该：(a)在其帐目和记录中单独列记属于本基金的证券，并且(b)要求和尽商业上的合理努力确保其境外托管人在其各自帐目和记录中单独清楚列记证券不属于境外托管人，不论证券以何人的名义登记。而且，若证券由基金托管人、境外托管人以无记名方式实际持有，要求和确保其境外托管人将这些证券和基金托管人、其境外托管人自有的资产、任何其他人的资产分别独立存放。

4、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

5、存放在证券系统的证券应按照基金托管人及其境外托管人的指示为基金的实益所有人持有，但须遵守管辖该系统运营的规则、条例和条件。

6、由基金托管人及其境外托管人为基金的利益而持有的证券(无记名证券和在证券系统持有的证券除外)应按本协议约定登记。

7、基金托管人及其委托应就其为基金管理人利益而持有证券的市场有关证券登记方式的重大改变通知基金管理人，并应基金管理人要求将这些市场发生的事件或惯例变化通知基金管理人。若基金管理人要求改变本协议约定的证券登记方式，基金托管人及其委托应就此予以充分配合。

（H）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人及其境外托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人及其境外托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人及其境外托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（I）与基金财产有关的重大合同的保管

基金管理人应及时向基金托管人提供涉及基金财产投资运作的书面协议的副本。

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。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当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。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门，保存时间应符合相关法律、法规要求。

（五）基金资产净值计算和会计核算

（A）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1. 会计核算和估值的处理原则

（1）基金资产的会计责任主体为基金管理人，基金管理人应根据与基金托管人协商确定的会计原则和核算方法进行会计处理。监管部门或行业组织另有约定的从其约定。基金托管人应根据与基金管理人协商确定的会计原则和核算方法对本基金进行会计处理、对资产净值计算进行复核。基金管理人应于 T+1 日完成 T 日估值，并提供基金托管人进行本基金的净值计算复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。基金管理人应依据与基金托管人协商确定的会计原则和会计准则进行会计处理。监管部门或行业组织另有约定的，从其约定。

基金托管人、境外托管人应按国家规定和基金管理人要求对基金资产中的证券账户和现金账户进行帐实核对。

（2）基金管理人有权委托第三方独立机构进行会计核算，并认可其委托的第三方独立机构所计算的基金资产净值，基金托管人对基金管理人认可的第三方独立机构所计算的资产净值进行复核。

2. 基金托管人的会计核算处理

（1）在遵守相关会计法律法规的前提下，基金托管人应按基金管理人和基金托管人协商确定的会计核算方法和处理原则进行会计核算，并按照基金管理人对资产的划分，分别对基

金财产单独建账、独立核算，并应指定专门人员负责会计核算与会计资料保管。属于基金财产的收益应全额计入会计账簿，不得与其他托管资产的收益相混淆。

(2) 基金资产核算的内容包括但不限于：证券买卖业务的核算、持有资产的付息、兑付、分红等业务的核算、证券发行认购业务的核算、货币市场工具买卖业务的核算、银行存款计息、存款账户间的资金划付业务的核算、支付费用的核算、汇兑损益的核算等。

3. 净值计算

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。份额净值是指基金资产净值除以份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 人民币，小数点后第 4 位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

(2) 基金资产净值的计算日为每一开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日，基金管理人和基金托管人在收集净值计算日估值价格截止时点所估值证券的最近市场价格后，对各类估值资产进行估值，计算出基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。本基金合同生效后，T+1 日完成 T 日估值，估值日后 2 个工作日内披露。

(B) 基金份额净值错误的处理方式

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或非直销销售机构、或投资者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的当事人（“受损方”）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无法预见、无法避免、无法抗拒，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者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承担；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）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿，但属于境外托管人原因造成基金资产损失的，由托管人负责追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

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

（7）按法律法规规定的其它原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

（C）暂停估值的情形

（1）与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因休市或暂停交易时；
（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）出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故；

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

（6）中国证监会认定的其他情形。

（D）特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按《基金合同》规定估值方法进行估值时，所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理。

（2）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、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。

（E）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，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录相符。

（F）基金定期报告的编制和复核

1、基金托管人法定报告

基金托管人需根据相关法律法规的规定向监管机构报告相关信息，包括但不限于以下内容：

（1）自开设境外结算账户之日起 5 日内，将有关账户的详情报告外管局；

（2）每月结束后7个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关监管规定进行国际收支申报；

（3）发现基金管理人投资指令或资金汇出违法、违规的，及时向中国证监会或外管局报告；

（4）中国证监会和国家外管局规定的其他报告事项；

上述报告应同时抄送基金管理人，对于基金托管人提供上述报告，基金管理人应予以支持和配合。

2、定期信息和报告

（1）基金托管人应按照本协议及时向基金管理人提供与基金财产托管业务相关的信息报告，包括但不限于定期报告的基金财产账户的相关评估报告、会计报表、估值报告、监管报告；

（2）应基金管理人要求，基金托管人及境外托管人可以就有关法律规定和市场惯例等事项向咨询机构进行咨询，但应谨慎处理该等咨询事项并向基金管理人报告有关结果。

（G）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度和准则执行。

（H）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算，基金托管人对本基金的基金资产净值计算进行复核。基金托管人和基金管理人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人应向基金管理人提供基金管理人进行本基金的净值计算复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。

（I）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。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有从事证券、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。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为法律法规规定的期限。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保管期限为法律法规规定的期限。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。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

（七）争议解决方式

1. 本托管协议适用中华人民共和国法律并依照其解释。相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会在北京仲裁，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方均有约束力。

2. 当任何争议发生或任何争议正在进行仲裁时，除争议事项外，双方仍有权行使本协议项下的其它权利并应履行本协议项下的其它义务。

二十三、对基金份额持有人的服务

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

（一）资料寄送/发送

1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易（除基金开户外其他交易类型）后的 15 个工作日内向基金份额持有人寄送或邮件发送开户确认书和交易对账单。

2、基金份额持有人对账单

每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

（二）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

（三）在线服务

通过本公司网站 www.jsfund.cn，基金份额持有人还可获得如下服务：

1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基金管理人网站 www.jsfund.cn 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

（四）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，传真：（010）65215577。

2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：service@jsfund.cn

二十四、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过规定媒介（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	关于嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)2025年8月1日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年7月30日
2	关于嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)2025年8月25日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年8月21日
3	关于嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)2025年9月1日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年8月28日
4	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2025年11月27日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年11月25日
5	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2025年12月24日至12月26日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年12月22日
6	嘉实黄金证券投资基金（LOF）溢价风险提示公告	2025年12月25日
7	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2025年12月31日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2025年12月29日
8	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2026年1月19日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	2026年1月15日
9	嘉实黄金证券投资基金（LOF）调整大额申购（含定期定额投资）业务的公告	2026年1月31日
10	嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	2026年2月3日
11	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年2月14日
12	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年2月28日
13	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年3月13日
14	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年3月27日
15	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2026年4月3日暂	2026年4月1日

	停赎回业务的公告	
16	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年4月10日
17	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年4月24日
18	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年5月8日
19	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2026年5月14日暂停赎回业务的公告	2026年5月12日
20	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2026年5月25日暂停赎回业务的公告	2026年5月21日
21	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年5月22日
22	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年6月5日
23	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年6月18日
24	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2026年6月26日
25	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）2026年7月3日暂停赎回业务的公告	2026年7月1日
26	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年7月3日
27	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2026年7月9日
28	关于嘉实黄金证券投资基金（LOF）暂停申购（含定期定额投资）业务的提示性公告	2026年7月17日

二十五、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、基金托管人及基金非直销销售机构住所，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。

二十六、备查文件

1. 中国证监会核准嘉实黄金证券投资基金（LOF）募集的文件；
2. 《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金合同》；
3. 《嘉实黄金证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

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
2026年08月22日