

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金招募说明书

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一九年

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2019年6月14日证监许可[2019]1121号文准予注册募集。

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

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金份额价格存在波动，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券市场、期货波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需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，自主判断基金的投资价值，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并自行承担投资风险。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险等。

本基金是股票型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金；本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于发售面值，本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回。即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

投资有风险，投资者在认购或申购本基金前应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及申购、赎回对价的交收方式已经认可。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。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资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

目 录

第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 基金管理人.....	8
第四部分 基金托管人.....	19
第五部分 相关服务机构.....	24
第六部分 基金的募集.....	26
第七部分 基金合同的生效.....	36
第八部分 基金份额折算.....	38
第九部分 基金份额的上市交易.....	39
第十部分 基金份额的申购与赎回.....	42
第十一部分 基金的投资.....	65
第十二部分 基金的财产.....	72
第十三部分 基金资产的估值.....	73
第十四部分 基金的收益与分配.....	79
第十五部分 基金的费用与税收.....	81
第十六部分 基金的会计与审计.....	84
第十七部分 基金的信息披露.....	85
第十八部分 风险揭示.....	92
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	99

第二十部分 基金合同的内容摘要.....	101
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要.....	102
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	103
第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式.....	104
第二十四部分 备查文件.....	105
附件一：基金合同内容摘要.....	106
附件二：托管协议内容摘要.....	124

第一部分 绪言

《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“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》”）、《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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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》”）及其他有关规定以及《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指国联安基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》所定义的机构投资者

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

23、投资人或投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

24、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”

25、ETF 联接基金或联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小

化，采用开放式运作方式的基金

26、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转托管等业务

28、销售机构：指国联安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

30、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的、在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

31、登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管和结算等业务

32、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。基金的登记结算机构为国联安基金管理有限公司或接受国联安基金管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构。本基金场内申赎、交易的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司

33、A 股账户：指上海证券交易所 A 股账户

34、基金账户：指上海证券交易所证券投资基金账户

35、证券账户：指 A 股账户和基金账户

36、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

37、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

38、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长

不得超过 3 个月

39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

41、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

43、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

45、业务规则：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、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关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、国联安基金管理有限公司发布的其他相关规则 and 规定

46、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

48、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额转换为基金合同约定的赎回对价的行为

49、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告场内申购对价、场内赎回对价等信息的文件

50、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

51、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

52、标的指数：指本基金跟踪的基准指数，是由中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 指数及其未来可能发生的变更

53、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资

者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

54、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

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

56、现金差额：指申购、赎回过程中，最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

57、基金份额参考净值：指上海证券交易所在交易时间内发布的基金管理人或其委托的机构根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算的基金份额参考净值，简称 IOPV

58、预估现金部分：指申购、赎回过程中，为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额

59、指定交易：指《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的“全面指定交易”

60、基金份额折算：指基金管理人根据基金合同规定在不改变投资者权益的前提下将投资者的基金份额净值及数量进行相应调整的行为

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

62、元：指人民币元

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

64、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

66、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

68、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

69、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

70、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

法定代表人：于业明

成立日期：2003年4月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：021-38992888

传真：021-50151880

联系人：黄娜娜

股权结构：

股东名称	持股比例
太平洋资产管理有限责任公司	51%
德国安联集团	49%

二、基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

于业明先生，董事长，经济学博士，高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长，华宝信托投资有限责任公司总经理，联合证券有限责任公司总经理，华宝投资有限公司总经理，华宝信托有限责任公司董事长，华宝证券有限责任公司董事长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长、总经理，国联安基金管理有限公司董事长。

Jiachen Fu（付佳晨）女士，副董事长，德国洪堡大学工商管理学士。历任

美国克赖斯勒汽车集团市场推广及销售部学员、戴姆勒东北亚投资有限公司金融及监控部成员、忠利保险公司内部顾问、安联全球车险驻中国业务发展主管兼创始人、安联集团董事会事务主任等职。现任安联资产管理公司管理董事兼中国业务发展总监、国联安基金管理有限公司副董事长。

孟朝霞女士，董事，经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理等职。现任国联安基金管理有限公司总经理。

杨一君先生，董事，工商管理硕士。历任美国通用再保险金融产品公司副总裁助理、中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心副总经理，太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、运营总监、风险管理部总经理、合规审计部总经理等职。现任太平洋资产管理有限责任公司总经理助理、财务负责人。

Anna Sophie Herken女士，董事，剑桥大学工商管理硕士、美利坚大学法学硕士。历任世界银行监察组顾问、柏林上诉法院书记员、柏林联邦经济技术部政务主任、世界银行监察组助理执行秘书长、欧洲复兴开发银行秘书长办公室首席顾问、柏林赫尔梯行政学院董事总经理、德国哈索·普拉特纳资本有限公司首席财务官、首席运营官及授权代表等职。现任安联资产管理有限公司业务部门主管。

陈有安先生，独立董事，工学博士。2016年4月退休前，历任国家开发银行华东地区信贷局副局长，国开行兰州分行行长、党委书记，甘肃省省长助理、党组成员，甘肃省省长助理兼贸易经济合作厅厅长、党组书记，甘肃省商务厅厅长、党组书记，甘肃省农村信用社联合社理事长、党委书记，中央汇金投资公司副总经理，中国银河金融控股公司董事长、党委书记，中国银河证券董事长、党委书记等职。

岳志明先生，独立董事，美国哥伦比亚大学工商管理硕士。历任野村证券国际金融部中国部负责人，野村国际（香港）中国投行部总经理、野村中国区首席执行官，美国华平投资集团董事总经理、全球合伙人等职。现任正大光明集团有限公司首席投资官。

胡斌先生，独立董事，特许金融分析师(CFA)，美国伊利诺伊大学(UIUC)工商管理硕士(MBA)、上海交通大学管理工程博士。历任纽约银行梅隆资产管理

公司Standish Mellon量化分析师、公司副总裁，Coefficient Global公司创始人之一兼基金经理、梅隆资产管理中国区负责人、纽银梅隆西部基金管理有限公司首席执行官（总经理）等职。现任上海系数股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）总经理。

2、监事会成员

段黎明先生，监事会主席，会计专业硕士、工商管理硕士。历任平安电子商务有限公司财务分析主管、中国平安保险（集团）股份有限公司财务企划部项目负责人、平安集团财务上海分部预算管理室主任、财务管理室主任，平安资产管理有限责任公司财务部负责人、首席财务官等职。现任太平洋资产管理有限责任公司财务部总经理。

Uwe Michel先生，监事，法律硕士。历任慕尼黑Allianz SE亚洲业务部主管、主席办公室主管、Allianz Life Insurance Japan Ltd. 主席及日本全国主管、德国慕尼黑Group OPEX安联集团内部顾问主管等职。现任慕尼黑Allianz SE业务部H5投资与亚洲主管。

刘涓女士，职工监事，经济学学士，现任国联安基金管理有限公司运营部副总监。

朱敏菲女士，职工监事，大学本科，现任国联安基金管理有限公司人力综合部资深行政经理。

3、高级管理人员

于业明先生，董事长，经济学博士，高级会计师。历任宝钢集团财务有限责任公司副总经理、常务副总经理、总经理、董事长，华宝信托投资有限责任公司总经理，联合证券有限责任公司总经理，华宝投资有限公司总经理，华宝信托有限责任公司董事长，华宝证券有限责任公司董事长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事等职。现任太平洋资产管理有限责任公司党委书记、董事长、总经理，国联安基金管理有限公司董事长。

孟朝霞女士，总经理，经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理、融通基金管理有限公司总经理等职。现任国联安基金管理有限公司总经理。

魏东先生，常务副总经理，首席投资官，经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；历任华宝兴业基金管理有限公司交易部总经理、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理、投资副总监、国内投资部总经理、国联安基金管理有限公司基金经理、总经理助理、投资总监等职。现任国联安基金管理有限公司常务副总经理并兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

李柯女士，副总经理，首席运营官、财务总监、首席信息官，经济学学士。历任中国建设银行上海分行国际业务部业务经理、上海联合财务有限公司资金财务部副经理、经理、营运负责人兼内部审计师、公司副总经理、国联安基金管理有限公司财务总监、总经理助理等职。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

蔡蓓蕾女士，副总经理，首席市场官，经济学博士。历任富国基金管理有限公司产品与营销部副总经理兼零售部副总经理、交银施罗德基金管理有限公司产品总监、泰康资产管理公司公募事业部市场业务负责人等职。现任国联安基金管理有限公司副总经理。

李华先生，督察长，经济学硕士。历任北京大学经济管理系讲师、广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估有限公司董事长、天一证券有限公司华南业务总部总经理、融通基金管理有限公司监察稽核部总监及监事、新疆前海联合基金管理有限公司督察长等职。现任国联安基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

黄欣先生，硕士研究生。2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理，现任量化投资部总监助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金的基金经理，2010年5月起至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2013年6月起至2017年3月兼任国联安中证股

债动态策略指数证券投资基金的基金经理，2016年8月起兼任国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 和国联安中证医药100指数证券投资基金的基金经理。2018年3月至2019年7月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年5月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年6月起任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司基金投资的最高投资决策机构。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、权益投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人及高级基金经理组成。投资决策委员会成员为：

权益投资决策委员会成员为：

孟朝霞（总经理）

魏东（常务副总经理）权益投委会主席

邹新进（权益投资部总经理）

杨子江（研究部副总经理）

刘斌（权益投资部副总监、基金经理）

潘明（权益投资部副总监、基金经理）

固定收益投资决策委员会成员为：

孟朝霞（总经理）

魏东（常务副总经理）固收投委会主席

欧阳健（固定收益部总经理兼养老金及FOF投资部总经理）

万莉（现金管理部总经理、基金经理）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购、赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、

变现和分配；

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

基金管理人内部风险控制包括内部控制机制和内部控制制度两个方面。内部控制机制是指公司的内部组织结构及其相互之间的运行制约关系；内部控制制度是指公司为防范金融风险，保护资产的安全与完整，促进各项经营活动的有效实施而制定的各种业务操作程序、管理方法与控制措施的总称。

1、内部控制的目标

本基金管理人内部控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理公司。具体来说，必须达到以下目标：

(1) 严格遵守国家有关法律法规和行业监管规章，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

(2) 健全符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机

制、执行机制和监督机制。

(3) 建立行之有效的风险控制系统，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整。

(4) 不断提高经营管理的效率和效益，努力实现公司价值的最大化，圆满完成公司的经营目标和发展战略。

2、内部控制机制的原则

公司完善内部控制机制必须遵循以下原则：

(1) 健全性原则。内部控制应当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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司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、公司制订内部控制制度必须遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制的基本要求

(1) 公司必须依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

1) 建立以一线岗位为基础的第一道监控防线。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) 建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。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。

3) 建立以督察长、监察稽核部、风险管理部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长、风险管理部和监察稽核部独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(2) 公司必须建立科学的授权批准制度和岗位分离制度。各业务部门和分支机构必须在适当的授权基础上实行恰当的责任分离制度，直接的操作部门或经办人员和直接的管理部门或控制人员必须相互独立、相互牵制。

(3) 公司必须建立完善的岗位责任制度和规范的岗位管理措施。在明确不同岗位的工作任务基础上，赋予各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制度、严格的操作程序和合理的工作标准，大力推行各岗位、各部门、各机构的目标管理。

(4) 公司必须真实、全面地记载每一笔业务，充分发挥会计的核算和监督职能，健全会计、统计、业务等各种信息资料及时、准确报送制度，确保各种信息资料的真实与完整。

(5) 公司必须建立严密有效的风险管理系统，包括主要业务的风险评估和监测办法、分支机构和重要部门的风险考核指标体系以及管理人员的道德风险防范系统等。通过严密的风险管理，及时发现内部控制的弱点，以便堵塞漏洞、消除隐患。

(6) 公司必须制订切实有效的应急应变措施，设定具体的应急应变步骤。尤其是投资交易等重要区域遇到断电、失火等非常情况时，应急应变措施要及时到位，并按预定功能发挥作用，以确保公司的正常经营不会受到不必要的影响。

5、内部风险控制的内容

公司内部风险控制的主要内容包括：投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、监察稽核控制等。

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并

采取控制措施。

(2) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(3) 公司根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。

(4) 公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(5) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的监察稽核控制制度，保证监察稽核部门的独立性和权威性。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 本基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任；

(2) 本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(3) 本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和基金管理人不断发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：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）

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3 号

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

二、主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%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、QFII 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 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《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 64 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制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，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。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设

置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互

控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。中国工商银行通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。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业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯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。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业

务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在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和发展的生命线。

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，其中对基金的投资的监督和核查自基金合同生效之日起开始。

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，基金管理人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对，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。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、网下现金和网下股票发售直销机构

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

法定代表人：于业明

客户服务电话：021-38784766，400-700-0365（免长途话费）

联系人：黄娜娜

网址：www.cpicfunds.com

2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

3、网上现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

4、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。

二、登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

负责人：周明

联系人：严峰

电话：（0755）25946013

传真：（0755）25987122

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 5 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心

11 楼

首席合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：钱祎彤

经办会计师：单峰、钱祎彤

第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并于 2019 年 6 月 14 日经中国证监会证监许可[2019]1121 号文准予注册募集。

一、基金的类别、运作方式、标的指数及存续期限

基金类型：股票型证券投资基金

基金运作方式：交易型开放式

标的指数：沪深 300 指数

基金存续期限：不定期

二、募集期限

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

自 2019 年 8 月 28 日到 2019 年 10 月 18 日，本基金同时对符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者进行发售。

如果在此期间未达到本招募说明书第七部分第一款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

三、募集场所

本基金通过基金管理人及其指定的发售代理机构向投资者公开发售，发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并另行公告。

四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合

格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

五、募集规模

本基金不设募集规模上限。

六、基金份额发售面值、认购价格

基金份额的发售面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

七、发售方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

基金投资者在募集期内可多次认购。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请，网下现金认购、网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

基金管理人、发售代理机构可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在基金份额发售公告或相关公告中列明。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并另行公告。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

八、认购开户

投资者认购本基金时需持有证券账户，证券账户是指上海证券交易所 A 股账户（以下简称“A 股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“基

金账户”）。

1、如投资者需新开立证券账户，则应注意：

（1）基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易。如投资者需要使用标的指数成份股或备选成分股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用标的指数成份股或备选成分股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

（2）开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

2、如投资者已开立证券账户，则应注意：

（1）如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

（2）当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少提前 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（3）使用专用交易单元的机构投资者无需办理指定交易。

九、认购费用

认购费用由投资者承担，认购费率如下表所示：

认购份额（M，份）	认购费率
$M < 50$ 万	0.5%
50 万 $\leq M < 100$ 万	0.3%
$M \geq 100$ 万	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。基金管理人在投资者提交认购申请时以现金方式向投资者收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不超过 0.5%的认购费率标准收取一定的佣金。投资者申请多次认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

十、网上现金认购

1、认购时间

详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

2、认购金额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金 = 固定费用）

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

（或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用）

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过某发售代理机构采用现金方式认购 1,000 份本基金基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.5%，则需准备的认购资金金额计算如下：

认购佣金 = $1.00 \times 1,000 \times 0.5\% = 5.00$ 元

认购金额 = $1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.5\%) = 1005.00$ 元

即投资者需准备 1005.00 元认购资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

3、认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，基金合同另有约定除外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记结算机构的确认为准。

4、认购手续

投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收

T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认

在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十一、网下现金认购

1、认购时间

详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人或指定发售代理机构确定。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

(1) 通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用 = 基金份额发售面值 × 认购份额 × 认购费率

(或若适用固定费用的，认购费用 = 固定费用)

认购金额 = 基金份额发售面值 × 认购份额 × (1 + 认购费率)

(或若适用固定费用的，认购金额 = 基金份额发售面值 × 认购份额 + 固定费用)

净认购份额 = 认购份额 + 认购金额产生的利息 / 基金份额发售面值

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

认购金额、认购费用的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者通过基金管理人认购本基金 800,000 份，认购费率为 0.3%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资者的认购金额为：

认购费用 = $1.00 \times 800,000 \times 0.3\% = 2,400.00$ 元

认购金额 = $1.00 \times 800,000 \times (1 + 0.3\%) = 802,400.00$ 元

该投资者所得认购份额为：

净认购份额 = $800,000 + 100 / 1.00 = 800,100.00$ 份

即，若该投资者通过基金管理人认购本基金 800,000 份，则该投资者的认购金额为 802,400.00 元，假定该笔认购金额产生的利息为 100 元，则可得到 800,100.00 份基金份额。

(2) 通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3、认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，但除基金合同另有约定外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记结算机构的确认为准。

4、认购手续

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

5、清算交收

T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于 T+2 日内进行有效认购款项的清算交收。管理人将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。其中，现金认购款项在募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认

基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十二、网下股票认购

1、认购时间

详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

2、认购限额

网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是标的指数的成份股和已经公告的备选成份股（具体见基金份额发售公告）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分必须为 100 股的整数倍。投资者可以多

次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

4、特殊情形

(1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

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

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4) 募集结束前，如标的指数成份股出现调整，则调入名单中的股票也可用于认购。

5、清算交收

网下股票认购期内每日日终，发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人。T 日日终（T 日为本基金募集期最后一日），基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人为投资者计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海市场和深圳市场的股票过户至本基金的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

6、认购份额的计算公式

投资者的认购份额 = $\sum_{i=1}^n$ （第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 ×

有效认购数量) / 1.00

其中:

(1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票, n 代表投资者提交的股票总只数。如投资者仅提交了 1 只股票的申请, 则 $i=1$ 。

(2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据, 以该股票的总成交金额除以总成交股数计算, 以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交, 则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动, 由于投资者获得了相应的权益, 基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整:

①除息: 调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息

②送股: 调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 / (1 + 每股送股比例)

③配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股配股比例)

④送股且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

⑤除息且送股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例)

⑥除息且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股配股比例)

⑦除息、送股且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1 + 每股送股比例 + 每股配股比例)

以上调整后价格采用四舍五入方法, 保留到小数点后 2 位。

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据此进行清算交收的股票股数。其中:

①对于经公告限制认购规模的个股, 基金管理人可确认的认购数量上限为:

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

q^{\max} 为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量, $Cash$ 为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额, $P_j q_j$ 为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积, w 为该限制认购规模的个股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日在标的指数中的权重(认购期间如有标的指数调整公告, 则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的各成份股构成权重, 并以其作为计算依据), P 为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限, 则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

②若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行, 则基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

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

十三、募集资金利息与募集股票权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息, 将折算为基金份额归投资者所有, 其中利息转份额以基金管理人的记录为准; 网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管账户前产生的利息, 计入基金财产, 不折算为投资者基金份额。投资者以股票认购的, 认购股票按照交易所和登记结算机构的规则和流程办理股票的冻结与过户, 最终将投资者申请认购的股票过户至基金证券账户。投资者的认购股票在募集冻结期间产生的权益归投资者所有。

十四、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, 网下股票认购所募集的股票按上海证券交易所及登记结算机构的规则和流程予以冻结, 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。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

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

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金托管人的监督职责自《基金合同》生效之日起开始。

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,网下股票认购所募集的股票按上海证券交易所及登记结算机构的规则和流程予以冻结,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息,已冻结的网下股票认购所募集的股票按上海证券交易所及登记结算机构的规则解冻;基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任,登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作;
- 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。

基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份额折算

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。

基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记，且无需召开基金份额持有人大会。基金份额折算后，基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除计算过程中涉及的尾数保留外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告，并提前通知基金托管人。基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的上市交易

一、基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

- 1、基金募集金额（含网下股票认购募集的股票市值）不低于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人不少于 1,000 人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。本基金基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在本基金基金份额上市日前按照相关法律法规要求发布基金份额上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

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

三、终止上市交易

本基金基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止本基金基金份额的上市交易：

- 1、不再具备本部分第一款规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日后按照《信息披露办法》的规定发布基金份额终止上市交易公告。

若因上述 1、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所

终止上市的，本基金将由交易型开放式证券投资基金变更为跟踪标的指数的非上市开放式基金，而无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

四、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一个交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，基金管理人或其委托的机构在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式

基金份额参考净值 = (申购、赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。若上海证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

五、在法律法规允许且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所同时挂牌交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

六、相关法律法规、中国证监会、登记结算机构及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

七、若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交

易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。经基金管理人推荐、上海证券交易所认可，特定机构投资者也可以直接办理基金申购赎回业务。基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，同时予以公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更、登记结算机构的业务规则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、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

本基金在上市交易之前可开始办理申购、赎回。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购、赎回。

三、申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的原则，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、本基金申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。
- 5、本基金申购赎回应遵守业务规则及其他有关的规定。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益、不违背上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关规则的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回申请的方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。

投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金，否则申购不成立；投资者交付申购对价，申购成立；登记结算机构确认基金份额时，申购生效。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则赎回不成立；登记结算机构确认赎回时，赎回生效。

2、申购和赎回申请的确认

投资人的申购、赎回申请在受理后由登记结算机构进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请不成立。

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

利。

基金管理人以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记结算机构在 T 日内对该交易的有效性进行确认。投资人应及时查询有关申请的确认情况，否则如因申请未得到登记结算机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。

投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。投资人赎回获得的股票当日可卖出。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用业务规则及其他有关规定。

对于本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代、申购并当日卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资人 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

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

基金管理人不得于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据业务规则及其他有关规定进行处理。

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

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

4、登记结算机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，对申购与赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

五、申购与赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需以最小申购、赎回单位的整数倍进行申报，最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整。本基金最小申购、赎回单位为 900,000 份。

2、基金管理人可根据市场情况，合理调整申购和赎回份额等数量限制，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，并在申购、赎回清单中公告。

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份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回等限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购、赎回的对价和费用及用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给

基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

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

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

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

七、申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

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

2、组合证券相关内容

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

3、现金替代相关内容

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

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

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

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

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

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

(2) 可以现金替代

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

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

“该证券参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

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

③替代金额的处理程序

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

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

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

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

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

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

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

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

“证券参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

“参考基金份额净值目”前为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

（3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的

成份证券,或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

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

(4) 退补现金替代

①适用情形:退补现金替代的证券目前仅适用于标的指数中深圳证券交易所股票。

②替代金额:对于退补现金替代的证券,替代金额的计算公式为:

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

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

③替代金额的处理程序

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

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

其中,调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数

成份证券的调整后开盘参考价确定。

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

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

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

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

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

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

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎

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

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

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

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

4、预估现金部分相关内容

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

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分，其计算公式为：

T 日预估现金部分 = T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与调整后 T 日开盘参考价相乘之和)

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

额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和})$ 。

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

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

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息：

最新公告日期	T 日
基金名称	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	国联安基金管理有限公司
一级市场基金代码	515661

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	-10644.96
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	909,000.00
基金份额净值（单位：元）	1.0100

T 日信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位:元)	-12562.29
------------------------	-----------

现金替代比例上限	50%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	900,000
是否允许申购和赎回	允许申购、允许赎回

成份股信息内容：

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
000001	平安银行	2400	深市退补现金替代	10.00%	
000002	万科A	1400	深市退补现金替代	10.00%	
000063	中兴通讯	700	深市退补现金替代	10.00%	
000069	华侨城A	1100	深市退补现金替代	10.00%	
000100	TCL 集团	3000	深市退补现金替代	10.00%	
000157	中联重科	1400	深市退补现金替代	10.00%	
000166	申万宏源	2600	深市退补现金替代	10.00%	
000333	美的集团	1400	深市退补现金替代	10.00%	
000338	潍柴动力	1300	深市退补现金替代	10.00%	
000402	金融街	300	深市退补现金替代	10.00%	
000408	藏格控股	200	深市退补现金替代	10.00%	
000413	东旭光电	1200	深市退补现金替代	10.00%	
000415	渤海租赁	500	深市退补现金替代	10.00%	
000423	东阿阿胶	100	深市退补现金替代	10.00%	
000425	徐工机械	1300	深市退补现金替代	10.00%	
000538	云南白药	100	深市退补现金替代	10.00%	
000553	安道麦A	100	深市退补现金替代	10.00%	
000568	泸州老窖	200	深市退补现金替代	10.00%	
000596	古井贡酒	100	深市必须现金替代		
000625	长安汽车	500	深市退补现金替代	10.00%	
000627	天茂集团	500	深市退补现金替代	10.00%	
000629	攀钢钒钛	1200	深市退补现金替代	10.00%	
000630	铜陵有色	1800	深市退补现金替代	10.00%	
000651	格力电器	1300	深市退补现金替代	10.00%	
000656	金科股份	600	深市退补现金替代	10.00%	
000661	长春高新	100	深市退补现金替代	10.00%	
000671	阳光城	400	深市退补现金替代	10.00%	
000703	恒逸石化	300	深市退补现金替代	10.00%	
000709	河钢股份	1200	深市退补现金替代	10.00%	
000725	京东方A	6700	深市退补现金替代	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

000728	国元证券	500	深市退补现金替代	10.00%	
000768	中航飞机	400	深市退补现金替代	10.00%	
000776	广发证券	800	深市退补现金替代	10.00%	
000783	长江证券	1100	深市退补现金替代	10.00%	
000786	北新建材	200	深市退补现金替代	10.00%	
000858	五粮液	500	深市退补现金替代	10.00%	
000876	新希望	600	深市退补现金替代	10.00%	
000895	双汇发展	300	深市退补现金替代	10.00%	
000898	鞍钢股份	700	深市退补现金替代	10.00%	
000938	紫光股份	100	深市退补现金替代	10.00%	
000961	中南建设	500	深市退补现金替代	10.00%	
000963	华东医药	200	深市退补现金替代	10.00%	
001979	招商蛇口	700	深市退补现金替代	10.00%	
002001	新和成	400	深市退补现金替代	10.00%	
002007	华兰生物	200	深市退补现金替代	10.00%	
002008	大族激光	200	深市退补现金替代	10.00%	
002010	传化智联	400	深市退补现金替代	10.00%	
002024	苏宁易购	1000	深市退补现金替代	10.00%	
002027	分众传媒	2900	深市退补现金替代	10.00%	
002032	苏泊尔	100	深市退补现金替代	10.00%	
002044	美年健康	600	深市退补现金替代	10.00%	
002050	三花智控	400	深市退补现金替代	10.00%	
002065	东华软件	500	深市退补现金替代	10.00%	
002081	金螳螂	500	深市退补现金替代	10.00%	
002120	韵达股份	100	深市退补现金替代	10.00%	
002142	宁波银行	800	深市退补现金替代	10.00%	
002146	荣盛发展	500	深市退补现金替代	10.00%	
002153	石基信息	100	深市退补现金替代	10.00%	
002179	中航光电	100	深市退补现金替代	10.00%	
002202	金风科技	800	深市退补现金替代	10.00%	
002230	科大讯飞	400	深市退补现金替代	10.00%	
002236	大华股份	500	深市退补现金替代	10.00%	
002241	歌尔股份	600	深市退补现金替代	10.00%	
002252	上海莱士	400	深市退补现金替代	10.00%	
002271	东方雨虹	200	深市退补现金替代	10.00%	
002294	信立泰	100	深市退补现金替代	10.00%	
002304	洋河股份	200	深市退补现金替代	10.00%	
002310	东方园林	500	深市退补现金替代	10.00%	
002311	海大集团	200	深市退补现金替代	10.00%	
002352	顺丰控股	200	深市退补现金替代	10.00%	
002410	广联达	200	深市退补现金替代	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

002411	延安必康	100	深市退补现金替代	10.00%	
002415	海康威视	1000	深市退补现金替代	10.00%	
002422	科伦药业	200	深市退补现金替代	10.00%	
002456	欧菲光	500	深市退补现金替代	10.00%	
002460	赣锋锂业	200	深市退补现金替代	10.00%	
002466	天齐锂业	200	深市退补现金替代	10.00%	
002468	申通快递	100	深市退补现金替代	10.00%	
002475	立讯精密	900	深市退补现金替代	10.00%	
002493	荣盛石化	400	深市退补现金替代	10.00%	
002508	老板电器	100	深市退补现金替代	10.00%	
002555	三七互娱	300	深市退补现金替代	10.00%	
002558	巨人网络	200	深市退补现金替代	10.00%	
002594	比亚迪	300	深市退补现金替代	10.00%	
002601	龙麟佰利	200	深市退补现金替代	10.00%	
002602	世纪华通	500	深市退补现金替代	10.00%	
002624	完美世界	100	深市退补现金替代	10.00%	
002625	光启技术	100	深市退补现金替代	10.00%	
002673	西部证券	500	深市退补现金替代	10.00%	
002714	牧原股份	200	深市退补现金替代	10.00%	
002736	国信证券	700	深市退补现金替代	10.00%	
002739	万达电影	200	深市退补现金替代	10.00%	
002773	康弘药业	100	深市退补现金替代	10.00%	
002925	盈趣科技	100	深市退补现金替代	10.00%	
002938	鹏鼎控股	100	深市退补现金替代	10.00%	
002939	长城证券	100	深市退补现金替代	10.00%	
002945	华林证券	100	深市退补现金替代	10.00%	
300003	乐普医疗	300	深市退补现金替代	10.00%	
300015	爱尔眼科	300	深市退补现金替代	10.00%	
300017	网宿科技	600	深市退补现金替代	10.00%	
300024	机器人	300	深市退补现金替代	10.00%	
300033	同花顺	100	深市退补现金替代	10.00%	
300059	东方财富	1500	深市退补现金替代	10.00%	
300070	碧水源	500	深市退补现金替代	10.00%	
300072	三聚环保	300	深市退补现金替代	10.00%	
300122	智飞生物	100	深市退补现金替代	10.00%	
300124	汇川技术	300	深市退补现金替代	10.00%	
300136	信维通信	200	深市退补现金替代	10.00%	
300142	沃森生物	300	深市退补现金替代	10.00%	
300144	宋城演艺	200	深市退补现金替代	10.00%	
300251	光线传媒	200	深市退补现金替代	10.00%	
300296	利亚德	500	深市退补现金替代	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

300408	三环集团	300	深市退补现金替代	10.00%	
300413	芒果超媒	100	深市退补现金替代	10.00%	
300433	蓝思科技	200	深市退补现金替代	10.00%	
300498	温氏股份	1000	深市退补现金替代	10.00%	
600000	浦发银行	3300	允许	10.00%	
600004	白云机场	300	允许	10.00%	
600009	上海机场	300	允许	10.00%	
600010	包钢股份	5000	允许	10.00%	
600011	华能国际	1200	允许	10.00%	
600015	华夏银行	1700	允许	10.00%	
600016	民生银行	6900	允许	10.00%	
600018	上港集团	900	允许	10.00%	
600019	宝钢股份	2500	允许	10.00%	
600023	浙能电力	1100	允许	10.00%	
600025	华能水电	500	允许	10.00%	
600027	华电国际	900	允许	10.00%	
600028	中国石化	3700	允许	10.00%	
600029	南方航空	1000	允许	10.00%	
600030	中信证券	2200	允许	10.00%	
600031	三一重工	1600	允许	10.00%	
600036	招商银行	2900	允许	10.00%	
600038	中直股份	100	允许	10.00%	
600048	保利地产	2000	允许	10.00%	
600050	中国联通	2600	允许	10.00%	
600061	国投资本	500	允许	10.00%	
600066	宇通客车	400	允许	10.00%	
600068	葛洲坝	700	允许	10.00%	
600085	同仁堂	100	允许	10.00%	
600089	特变电工	1000	允许	10.00%	
600100	同方股份	600	允许	10.00%	
600104	上汽集团	1000	允许	10.00%	
600109	国金证券	700	允许	10.00%	
600111	北方稀土	600	允许	10.00%	
600115	东方航空	1100	允许	10.00%	
600118	中国卫星	200	允许	10.00%	
600153	建发股份	400	允许	10.00%	
600170	上海建工	1300	允许	10.00%	
600176	中国巨石	600	允许	10.00%	
600177	雅戈尔	1000	允许	10.00%	
600188	兖州煤业	300	允许	10.00%	
600196	复星医药	300	允许	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

600208	新潮中宝	1200	允许	10.00%	
600219	南山铝业	2100	允许	10.00%	
600221	海航控股	3300	允许	10.00%	
600233	圆通速递	100	允许	10.00%	
600271	航天信息	300	允许	10.00%	
600276	恒瑞医药	900	允许	10.00%	
600297	广汇汽车	900	允许	10.00%	
600299	安迪苏	100	允许	10.00%	
600309	万华化学	400	允许	10.00%	
600332	白云山	200	允许	10.00%	
600339	中油工程	500	允许	10.00%	
600340	华夏幸福	500	允许	10.00%	
600346	恒力石化	300	允许	10.00%	
600352	浙江龙盛	700	允许	10.00%	
600362	江西铜业	300	允许	10.00%	
600369	西南证券	800	允许	10.00%	
600372	中航电子	100	允许	10.00%	
600383	金地集团	600	允许	10.00%	
600390	五矿资本	200	允许	10.00%	
600398	海澜之家	500	允许	10.00%	
600406	国电南瑞	500	允许	10.00%	
600415	小商品城	700	允许	10.00%	
600436	片仔癀	100	允许	10.00%	
600438	通威股份	500	允许	10.00%	
600482	中国动力	200	允许	10.00%	
600487	亨通光电	400	允许	10.00%	
600489	中金黄金	500	允许	10.00%	
600498	烽火通信	200	允许	10.00%	
600516	方大炭素	500	允许	10.00%	
600519	贵州茅台	100	允许	10.00%	
600522	中天科技	700	允许	10.00%	
600535	天士力	300	允许	10.00%	
600547	山东黄金	300	允许	10.00%	
600566	济川药业	100	允许	10.00%	
600570	恒生电子	200	允许	10.00%	
600583	海油工程	600	允许	10.00%	
600585	海螺水泥	600	允许	10.00%	
600588	用友网络	300	允许	10.00%	
600606	绿地控股	1000	允许	10.00%	
600637	东方明珠	600	允许	10.00%	
600660	福耀玻璃	400	允许	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

600663	陆家嘴	200	允许	10.00%	
600674	川投能源	500	允许	10.00%	
600688	上海石化	600	允许	10.00%	
600690	海尔智家	1000	允许	10.00%	
600703	三安光电	700	允许	10.00%	
600704	物产中大	500	允许	10.00%	
600705	中航资本	1500	允许	10.00%	
600733	北汽蓝谷	100	允许	10.00%	
600741	华域汽车	400	允许	10.00%	
600760	中航沈飞	100	允许	10.00%	
600795	国电电力	3200	允许	10.00%	
600809	山西汾酒	100	允许	10.00%	
600816	安信信托	600	允许	10.00%	
600837	海通证券	2300	允许	10.00%	
600867	通化东宝	300	允许	10.00%	
600886	国投电力	900	允许	10.00%	
600887	伊利股份	1700	允许	10.00%	
600893	航发动力	200	允许	10.00%	
600900	长江电力	1800	允许	10.00%	
600919	江苏银行	1900	允许	10.00%	
600926	杭州银行	600	允许	10.00%	
600958	东方证券	1000	允许	10.00%	
600977	中国电影	200	允许	10.00%	
600998	九州通	200	允许	10.00%	
600999	招商证券	800	允许	10.00%	
601006	大秦铁路	1700	允许	10.00%	
601009	南京银行	1600	允许	10.00%	
601012	隆基股份	700	允许	10.00%	
601018	宁波港	1100	允许	10.00%	
601021	春秋航空	100	允许	10.00%	
601066	中信建投	100	允许	10.00%	
601088	中国神华	900	允许	10.00%	
601108	财通证券	700	允许	10.00%	
601111	中国国航	900	允许	10.00%	
601117	中国化学	600	允许	10.00%	
601138	工业富联	300	允许	10.00%	
601155	新城控股	300	允许	10.00%	
601162	天风证券	200	允许	10.00%	
601166	兴业银行	4100	允许	10.00%	
601169	北京银行	4200	允许	10.00%	
601186	中国铁建	1300	允许	10.00%	

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

601198	东兴证券	400	允许	10.00%	
601211	国泰君安	1300	允许	10.00%	
601212	白银有色	200	允许	10.00%	
601216	君正集团	900	允许	10.00%	
601225	陕西煤业	1100	允许	10.00%	
601228	广州港	500	允许	10.00%	
601229	上海银行	2000	允许	10.00%	
601238	广汽集团	300	允许	10.00%	
601288	农业银行	10700	允许	10.00%	
601298	青岛港	100	允许	10.00%	
601318	中国平安	3000	允许	10.00%	
601319	中国人保	300	允许	10.00%	
601328	交通银行	7700	允许	10.00%	
601336	新华保险	200	允许	10.00%	
601360	三六零	100	允许	10.00%	
601377	兴业证券	1300	允许	10.00%	
601390	中国中铁	2100	允许	10.00%	
601398	工商银行	6000	允许	10.00%	
601555	东吴证券	700	允许	10.00%	
601577	长沙银行	100	允许	10.00%	
601600	中国铝业	1800	允许	10.00%	
601601	中国太保	900	允许	10.00%	
601607	上海医药	300	允许	10.00%	
601618	中国中冶	2000	允许	10.00%	
601628	中国人寿	500	允许	10.00%	
601633	长城汽车	300	允许	10.00%	
601668	中国建筑	5900	允许	10.00%	
601669	中国电建	2100	允许	10.00%	
601688	华泰证券	1000	允许	10.00%	
601727	上海电气	1000	允许	10.00%	
601766	中国中车	2700	允许	10.00%	
601788	光大证券	500	允许	10.00%	
601800	中国交建	600	允许	10.00%	
601808	中海油服	200	允许	10.00%	
601818	光大银行	4500	允许	10.00%	
601828	美凯龙	100	允许	10.00%	
601838	成都银行	500	允许	10.00%	
601857	中国石油	2200	允许	10.00%	
601877	正泰电器	200	允许	10.00%	
601878	浙商证券	400	允许	10.00%	
601881	中国银河	300	允许	10.00%	

601888	中国国旅	300	允许	10.00%	
601898	中煤能源	500	允许	10.00%	
601899	紫金矿业	3400	允许	10.00%	
601901	方正证券	1200	允许	10.00%	
601919	中远海控	1100	允许	10.00%	
601933	永辉超市	1100	允许	10.00%	
601939	建设银行	1900	允许	10.00%	
601985	中国核电	1300	允许	10.00%	
601988	中国银行	5900	允许	10.00%	
601989	中国重工	2500	允许	10.00%	
601992	金隅集团	900	允许	10.00%	
601997	贵阳银行	600	允许	10.00%	
601998	中信银行	900	允许	10.00%	
603019	中科曙光	200	允许	10.00%	
603156	养元饮品	100	允许	10.00%	
603160	汇顶科技	100	必须		
603259	药明康德	100	允许	10.00%	
603260	合盛硅业	100	允许	10.00%	
603288	海天味业	200	允许	10.00%	
603799	华友钴业	200	允许	10.00%	
603833	欧派家居	100	必须		
603858	步长制药	200	允许	10.00%	
603986	兆易创新	100	允许	10.00%	
603993	洛阳钼业	1900	允许	10.00%	

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 6、证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购、赎回清单无法编

制或编制不当；

7、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单或者开市后发现 IOPV 计算错误、申购、赎回清单编制错误；

8、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限的情形；

9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的；

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

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价；

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

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

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形；

5、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单或者开市后发现 IOPV 计算错误、申购、赎回清单编制错误；

6、证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购、赎回清单无法编制或编制不当；

7、在发生标的指数成份股上市公司重大行为（如兼并重组）、成份股市场价

格异常波动等异常情形时；

8、基金管理人可根据市场情况在申购、赎回清单中设置赎回份额上限，如果一笔新的份额赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购、赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；

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，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请；

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 8 项以外情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应在当日报中国证监会备案。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、其他申购赎回方式

1、对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。本基金在基金合同生效后，开放日常申购之前，有权向本基金联接基金开通特殊申购。

2、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

3、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

4、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

十一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记结算机构认可、符合法律法规的其它非交易过

户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人，或按法律法规或有权机关规定的方式处理。

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

十二、基金的登记和转托管

1、基金份额的登记

本基金场内份额由中国证券登记结算有限责任公司负责办理登记结算。

2、基金份额的转托管

登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管等业务，并收取一定的手续费用。

十三、基金份额的冻结和解冻

基金登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户/A股账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

十四、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记结算机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十五、其他

基金管理人可在法律法规允许的范围内,在不影响基金份额持有人实质利益的前提下,根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第十一部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

三、投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标

的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）标的指数编制方法发生变化；（7）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

2、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。

3、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。

4、可转换债券和可交换债券投资策略

本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券，根据基金资产组合情况可适度进行投资。

5、金融衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。

本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

6、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律

法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

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

(3) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(7) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总

资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

(9) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

4) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(10) 本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对

手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(6)、(13)、(14)项外,因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,

按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

五、业绩比较基准

本基金的标的指数为沪深 300 指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

沪深 300 指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深 300 的价格指数。本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数和业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案并公告。若标的指数和业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，经基金管理人与基金托管人协商一致，按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三

人牟取任何不当利益。

第十二部分 基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十三部分 基金资产的估值

一、估值日

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

二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值原则

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

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

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

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

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事

件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市的债券（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票和非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按该债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

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

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

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

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

五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值

的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基

基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或由于证券、期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十四部分 基金的收益与分配

一、基金收益分配原则

1、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，基金管理人可以进行收益分配。具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式为现金分红；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

二、收益分配方案

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

三、基金收益分配数额的确定原则

1、在基金收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率和标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为基金收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期累计报酬率为基金收益评价日标的指数收盘

值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

当基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，基金管理人可以进行收益分配。

2、本基金以使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率为原则确定收益分配数额。

四、收益分配方案的确定、公告与实施

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

五、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

第十五部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市费及年费；
- 9、标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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 0.05% 的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数许可使用费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于下一个季度开始后10个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的计算方法、费率和支付方式。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

四、基金税收

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

第十六部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

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

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业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并报中国证监会备案。

第十七部分 基金的信息披露

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

二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，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、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

（四）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

根据投资需要或为提高交易便利，基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金管理人确定基金份额折算日后应按照相关法律法规的要求将基金份额折算日公告登载于指定媒介上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应按照相关法律法规的要求将基金份额折算结果公告登载于指定媒介上。

（五）基金份额上市交易公告书

本基金基金份额获准在上海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按照相关法律法规的要求将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

（六）基金资产净值、基金份额净值

《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。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个估值日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

（七）申购、赎回清单

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

（八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人

主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的规定编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年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、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、基金管理费、基金托管费、指数许可使用费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记结算机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 24、基金变更标的指数；
- 25、基金份额停复牌或终止上市；
- 26、调整最小申购、赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- 27、本基金变更份额类别设置；
- 28、基金推出新业务或服务；
- 29、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；
- 30、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

（十）澄清公告

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

（十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十二）投资股指期货相关公告

本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更

新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

(十三) 投资资产支持证券相关公告

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

(十四) 参与融资和转融通证券出借交易相关公告

基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

(十五) 投资流通受限证券的信息披露

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后 2 个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

(十六) 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,指定专人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、赎回清单、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

第十八部分 风险揭示

一、投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险。

1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将使本基金资产面临潜在的风险,本基金的市场风险来源于标的指数成份股和备选成份股股票资产与债券资产市场价格的波动。影响股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素:

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动,影响基金收益而产生风险。

(2) 经济周期风险

经济运行具有周期性的特点,证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响,也呈现周期性变化,基金投资于上市公司的股票与债券,其收益水平也会随之发生变化,从而产生风险。

(3) 利率风险

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

(4) 通货膨胀风险

基金份额持有人的收益将主要通过现金形式来分配,如果发生通货膨胀,现金的购买力会下降,从而影响基金的实际收益。

(5) 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使基金投资收益下降。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险,但并不能完全消除该种风险。

(6) 债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险,单一的

久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

(7) 再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率,这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

二、本基金特有的风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

2、标的指数波动的风险

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

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

5、IOPV 计算错误的风险

证券交易所发布的由基金管理人或其委托的机构计算的基金份额参考净值(IOPV),供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份

额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担后果。

6、退市风险

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

7、投资者申购失败的风险

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

投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的申购赎回代理券商如发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

8、投资者赎回失败的风险

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

9、基金份额赎回对价的变现风险

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

10、股指期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金参与股指期货交易。股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金

交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货标的指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。此外，交易所对股指期货的交易限制与规定会对基金投资股指期货的策略执行产生影响，从而对基金收益产生不利影响。

11、资产支持证券投资风险

本基金拟投资资产支持证券，除了面临债券所需要面临的信用风险、市场风险和流动性风险外，还面临资产支持证券的特有风险：提前赎回或延期支付风险，可能造成基金财产损失。

12、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

13、标的指数变更的风险

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

14、退补现金替代方式的风险

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

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

15、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

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

三、流动性风险

1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”章节。

2、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

(1) 基金合同约定：“本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。”，标的指数为沪深 300 指数。其中“本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%”，从投资范围和所处的行业上看，基金资产及该类股票的流动性良好；

(2) 从投资限制上看，基金合同约定：“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》”。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

(1) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回对价

具体措施，详见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”中“暂停

赎回或延缓支付赎回对价的情形”的相关内容。

（2）暂停基金估值

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，并采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

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

四、管理风险

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。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能符合基金合同的要求，不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

2、新产品创新带来的风险

随着中国证券市场与国际市场的接轨，各种国外的投资工具也逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产保值增值的同时，也会产生一些新的投资风险，例如可转换债券带来的转股风险等。同时，基金管理人可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误，产生投资风险。

五、合规性风险

指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

六、操作风险

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

统故障等风险。

七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

八、其他风险

1、随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

声明：

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

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

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，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》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

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

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

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

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。

第二十部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

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

一、资讯服务

投资者如果了解基金产品与服务等信息，可拨打本基金管理人客户服务中心电话021-38784766、400-7000-365（免长途话费）或登录本基金管理人网站www.cpicfunds.com进行咨询和查询。

二、客户投诉受理服务

投资者可以通过电话（021-38784766，400-7000-365）、邮件（customer.service@cpicfunds.com）、网上留言、书信等主要投诉受理渠道对基金管理人的工作提出投诉和建议，客户服务人员会及时地进行处理。

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

第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书（包括更新的招募说明书）存放在基金管理人、基金托管人、基金销售机构的住所，投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

第二十四部分 备查文件

- 1、中国证监会对本基金的募集作出准予注册的文件
- 2、基金合同
- 3、法律意见书
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、托管协议
- 7、中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

国联安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十三日

附件一：基金合同内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一) 基金管理人

一) 基金管理人简况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

法定代表人：于业明

成立日期：2003 年 4 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：五十年或股东一致同意延长的其他期限

联系电话：(021) 38992888

二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处

理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；

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

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购、赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 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;

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人

一) 基金托管人简况

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: 陈四清

成立时间: 1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号: 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)

注册资本: 人民币 35,640,625.7089 万元

存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3 号

二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

(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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基

金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(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对价的现金部分；

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》、《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，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，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购款项或认购股票、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代

表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

（一）召开事由

一）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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

- 1、终止《基金合同》；
- 2、更换基金管理人；
- 3、更换基金托管人；
- 4、转换基金运作方式；
- 5、调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6、变更基金类别；

- 7、本基金与其他基金的合并；
- 8、变更基金投资目标、范围或策略；
- 9、变更基金份额持有人大会程序；
- 10、终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 11、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 12、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；
- 13、对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 14、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

二）在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，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、调低除基金管理费、基金托管费外的其他应由基金承担的费用；
- 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、调低赎回费率或变更收费方式；
- 4、增加、减少或调整基金份额类别；
- 5、因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 6、对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- 7、基金管理人、登记结算机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则；
- 8、本基金推出新业务或新服务；
- 9、调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- 10、调整基金份额净值、申购、赎回清单的计算和公告时间或频率；
- 11、在对基金投资无实质性影响的前提下更换本基金的标的指数（包括但不

限于编制机构变更、指数更名等)；

12、按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

一) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，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、地点和会议形式；
- 2、会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3、有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4、授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5、会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7、召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会、通讯开会或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合

同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

(4) 上述第 (3) 项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人

出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记结算机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面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。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

(八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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。

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

三、《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，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》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(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。

四、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如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，按照该机构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别

行政区和台湾地区法律)管辖。

五、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式三份,除上报有关监管机构一份外,基金管理人、基金托管人各持有一份,每份具有同等的法律效力。

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

附件二：托管协议内容摘要

第一节 托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：国联安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

法定代表人：于业明

成立时间：2003 年 4 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42 号

注册资本：1.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

电话：（021）38992888

（二）基金托管人

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：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

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 35,640,625.7089 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

第二节 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人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：

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

(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) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净

值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

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

3) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

5) 本基金管理人管理并由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

9) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

c. 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

d. 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

e.本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

10) 本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(3) 法规允许的基金投资比例调整期限

除前述第（2）条第 6）、11）、12）项外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，但需与基金托管人协商一致方可纳入投资监督范围。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资。

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

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场投资进行监督。

基金管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以 DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

5、关于银行存款投资

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。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(3) 基金投资非公开发行股票前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(4) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解

决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

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

(三) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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。

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

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。

第三节 基金管理人 对基金托管人的业务核查

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等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据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。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故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》、托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予以协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人 有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理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管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

第四节 基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

（二）募集资金的验证

基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应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。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。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。

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

（三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及

银行业监督管理机构的其他规定。

(四) 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

(五) 债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

(六) 其他账户的开设和管理

在托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

(七) 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的保管库或存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金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以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

(八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同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，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。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 15 年以上。

第五节 基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算

1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值及基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

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，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（二）基金资产估值方法

1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2、估值方法

本基金的估值方法为：

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市的债券（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票和非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按该债券所处的市场分别估值。

(5) 股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经

济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

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

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

(三) 估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

基金管理人或基金托管人按估值方法第(6)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。

由于不可抗力，或由于证券、期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责

任。

（四）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全套账册，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。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

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完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（五）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以传真方式将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 30 日内完成半年度报告，在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

第六节 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益登记日、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。基金份额登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年。

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益登记日、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日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，保存期限为 15 年。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。

第七节 基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（二）基金财产的清算

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

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

5、基金财产清算程序：

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

6、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剩余财产中支付。

(三) 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财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(四) 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。

第八节 争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，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，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

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