

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数  
证券投资基金招募说明书（更新）**

**2019 年 12 月 4 日公告**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2014年8月19日证监许可[2014]870号文注册募集。MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同于2015年2月12日正式生效。本基金由MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更注册而来，本基金经中国证监会2018年7月10日证监许可[2018]1091号文准予变更注册。自2018年9月17日起，《MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效，《华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金正式变更为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特定风险等。本基金是股票基金，风险和收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

对于场内申购，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机构若发生交收违约，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。

场外申购赎回业务的申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整。投资者在办理场外申购、赎回业务之前请仔细阅读本基金的招募说明书及基金管理人的相关公告。

场内投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能

进行基金的二级市场交易，如投资者需要参与基金的场内申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户。

场外现金申购、赎回本基金时需具有华夏基金管理有限公司基金账户；场外股票申购、赎回时投资者需按规定相应开立上海证券交易所、深圳证券交易所A股账户。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容更新截止日为2019年12月4日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年6月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 目录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                  | 1   |
| 二、释义.....                  | 1   |
| 三、基金管理人.....               | 4   |
| 四、基金托管人.....               | 12  |
| 五、相关服务机构.....              | 14  |
| 六、基金的历史沿革.....             | 24  |
| 七、基金的存续.....               | 25  |
| 八、基金份额的交易.....             | 25  |
| 九、基金份额的申购与赎回.....          | 26  |
| 十、基金的投资.....               | 54  |
| 十一、基金的财产.....              | 62  |
| 十二、基金资产的估值.....            | 63  |
| 十三、基金的收益与分配.....           | 67  |
| 十四、基金的费用与税收.....           | 68  |
| 十五、基金的会计与审计.....           | 70  |
| 十六、基金的信息披露.....            | 71  |
| 十七、风险揭示.....               | 76  |
| 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 82  |
| 十九、基金合同的内容摘要.....          | 84  |
| 二十、基金托管协议的内容摘要.....        | 98  |
| 二十一、对基金份额持有人的服务.....       | 106 |
| 二十二、招募说明书存放及查阅方式.....      | 107 |
| 二十三、备查文件.....              | 108 |

## 一、绪言

《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》（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》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《华夏 MSCI 中国 A 股国际通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。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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

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：指华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金管理人：指华夏基金管理有限公司。
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司。
- 4、基金合同、《基金合同》：指《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充。
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华夏 MSCI 中国 A 股国际通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：指《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募

说明书》及其更新。

7、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。

8、《基金法》：指《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。

9、《销售办法》：指《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。

10、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

11、《运作办法》：指《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。

12、《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。

13、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”。

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

15、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。

16、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。

17、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。

18、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。

19、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。

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和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。

21、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。

22、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、赎回等业务。

23、销售机构：指基金管理人及本基金代销机构。

24、代销机构：指发售代理机构和/或申购赎回代理机构。

25、发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。

26、申购赎回代理机构：指基金管理人指定的代理本基金申购、赎回业务的机构。

27、登记业务：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、托管和结算业务。

28、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和华夏基金管理有限公司。本基金份额在上海证券交易所场内上市交易以及申购、赎回等相关业务，以及场外股票申购、赎回等相关业务的登记结算由中国证券登记结算有限责任公司负责办理；本基金的场外现金申购、赎回等相关业务的登记结算由华夏基金管理有限公司负责办理。

29、场内：指通过上海证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所。

30、场外：指不通过上海证券交易所交易系统而通过销售机构自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的场所。

31、基金合同生效日：指《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效之日，原《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自同一日失效。

32、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。

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限。

34、工作日：指上海证券交易所的正常交易日。

35、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。

36、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。

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）。

38、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。

39、《业务规则》：指基金管理人、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则 and 规定。

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

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为。

42、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。

43、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。

44、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。

45、标的指数：指 MSCI 公司编制并发布的 MSCI 中国 A 股国际通指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人根据需要更换的其他指数。

46、最小申购、赎回单位：指基金场内、场外股票申购份额、赎回份额的最低数量，投资者场内、场外股票申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍。

47、元：指人民币元。

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

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数。

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

53、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。

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

55、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。

56、基金产品资料概要：指《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司



住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：邱曦

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

| 持股单位                            | 持股占总股本比例 |
|---------------------------------|----------|
| 中信证券股份有限公司                      | 62.2%    |
| POWER CORPORATION OF CANADA     | 13.9%    |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 13.9%    |
| 天津海鹏科技咨询有限公司                    | 10%      |
| 合计                              | 100%     |

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员，华夏基金（香港）有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中信信托董事，信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McInerney 先生：董事，硕士。现任万信投资公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

翟海涛先生：董事，硕士。现任春华资本集团总裁、合伙人，兼任中国光大国际有限公司及中国光大水务有限公司独立非执行董事等。曾任高盛（亚洲）有限责任公司董事总经理、高盛集团北京代表处首席代表、高盛集团与中国工商银行战略合作办公室主任、中国财政部和国家开发银行信用评级顾问等。

杨冰先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、资产管理业务投资主管等。

李勇进先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、中信证券财富管理委员会主任。兼任中信期货有限公司董事、金通证券有限责任公司执行董事兼总经理。

曾任中国农业银行大连市分行国际业务部科员，申银万国证券大连营业部部门经理，中信证券大连营业部总经理助理、副总经理、总经理，中信证券经纪业务管理部高级副总裁、总监，中信证券（浙江）有限责任公司总经理，中信证券浙江分公司总经理，中信证券经纪业务发展与管理委员会主任等。

李一梅女士：董事、总经理，硕士。兼任证通股份有限公司董事、华夏基金（香港）有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理，上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

张平先生：独立董事，博士。现任中国社科院经济研究所研究员。兼任民生通惠资产管理公司及香港中航工业国际独立董事。曾任中国社科院经济研究所宏观研究室副主任、经济增长室主任、所长助理、副所长，国家金融与发展实验室副主任等。

张宏久先生：独立董事，硕士。现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。兼任中信信托有限公司独立董事，全国律师协会金融专业委员会顾问，全国侨联法律顾问委员会委员及民事法律委员会主任，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员等。

支晓强先生：独立董事，博士。现任中国人民大学继续教育处处长、商学院财务与金融系教授、博士生导师。兼任全国会计专业学位研究生教育指导委员会委员兼副秘书长、中国会计学会财务成本分会副会长、财政部企业会计准则咨询委员会咨询专家、中国会计学会内部控制专业委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会委员、北农大科技股份有限公司独立董事等。

杨一夫先生：监事长，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司（Power Corporation of Canada）在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表，华夏基金管理有限公司董事等。

杨维华先生：监事，硕士。现任中信证券股份有限公司风险管理部行政负责人、公司副首席风险官。曾任中信证券股份有限公司风险管理部 B 角（主持工作）、总监等。

史本良先生：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部联席负责人、公司副财务总监。曾任中信证券股份有限公司计划财务部 B 角、总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。

曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任基金运作部 B 角等。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任华夏基金（香港）有限公司首席执行官、中国石化销售股份有限公司董事、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、合规部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人等。

## 2、本基金基金经理

荣膺女士，北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）等，现任数量投资部高级副总裁，上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日起任职）、华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日起任职）、华夏中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日起任职）、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金（LOF）基金经理（2016 年 10 月 27 日起任职）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日起任职）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日起任职）、

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日起任职）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 10 月 19 日起任职）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日起任职）、华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 6 月 14 日起任职）、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 6 月 21 日起任职）、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日起任职）、华夏创业板低波蓝筹交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日起任职）、华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 24 日起任职）。

### 3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

宋洋女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

### 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制中期和年度基金报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

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

2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并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。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券。
- (2) 向他人贷款或者提供担保。
- (3) 从事承担无限责任的投资。
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资。
- (5) 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。
- (6) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

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

#### 5、基金经理承诺

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

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

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度

及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

### 1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

（1）公司引入了独立董事制度，目前有独立董事 3 名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

（2）公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。

（3）公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，并进行持续教育。

### 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

### 3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务流程的科学、合理和标准化，并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核；在岗位责任制度上，内部岗位分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置，相互检查、相互制约。

#### （1）投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建，基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度，防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例；基金经理小组在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令，对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；交易管理部依据基金经理或基金经理授权的小组成员的指令负责交易执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线，交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定，对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控；风险管理部进行事中的监控；监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

## （2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

## （3）技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行，公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

## （4）人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

## （5）监察制度

公司设立了监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

## （6）反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构，指定专门人员负责反洗钱和

反恐融资合规管理工作；各相关部门设立了反洗钱岗位，配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外，公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程，确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

#### 4、信息沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化，不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

#### 5、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门，通过定期或不定期检查，评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。
- （2）上述关于内部控制的披露真实、准确。
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：010-66594942

中国银行客服电话：95566



## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

## （三）证券投资基金托管情况

截至2019年9月30日，中国银行已托管721只证券投资基金，其中境内基金681只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

## （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管

理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：张德根

网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)

#### 2、申购赎回代理机构

##### （1）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

客户服务电话：95521

##### （2）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

（3）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：李颖

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

（4）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：95565

（5）广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

（6）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：郑慧

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

客户服务电话：95548

（7）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

客户服务电话：95553、400-888-8001

（9）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：陈宇

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

客户服务电话：95523、400-889-5523

（10）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务电话：95579、400-888-8999

（11）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

客户服务电话：95517

（12）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

电话：023-67616310

传真：023-63786212

联系人：周青

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：400-809-6096

（13）万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：95322

（14）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

网址：www.htsc.com.cn

客户服务电话：95597

（15）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

联系人：刘晓明

网址：<http://sd.citics.com>

客户服务电话：95548

（16）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：尹旭航

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

客户服务电话：95321

（17）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

客户服务电话：95571

（18）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

联系人：李春芳

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（19）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

客户服务电话：95525、400-888-8788

（20）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客户服务电话：95360

（21）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

客户服务电话：95570

（22）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：章宏韬



电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：范超

网址：www.hazq.com

客户服务电话：95318

（23）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人：-

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（24）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：021-20315125

联系人：许曼华

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（25）德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

电话：021-68761616-8076

传真：021-68767032

联系人：刘熠

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

客户服务电话：400-888-8128

（26）中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

客户服务电话：010-65051166

（27）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967552

传真：021-54967032

联系人：杨莉娟

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客户服务电话：95323、400-109-9918

（28）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

联系人：胡芷境

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

客户服务电话：400-600-8008、95532

（29）联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

电话：0755-83331195

联系人：彭莲

网址：www.lxsec.com

客户服务电话：95564

（30）华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路 166 号 27 楼

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号 27 楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

网址：www.cnhbstock.com

客户服务电话：400-820-9898

基金管理人可根据有关法律法规、交易所、登记机构等的规定，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。具体申购赎回代理机构详见本基金管理人届时发布的相关公告。

3、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

4、本基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。

（二）登记机构

1、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

法定代表人：周明

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

2、名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：朱威

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

（四）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 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：单峰、赵雪

经办注册会计师：单峰、赵雪

## 六、基金的历史沿革

MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2014年8月19日证监许可

[2014]870号文注册募集。MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同于2015年2月12日正式生效。本基金由MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更注册而来，本基金经中国证监会2018年7月10日证监许可[2018]1091号文准予变更注册。

2018年9月12日MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。会议审议了《关于MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》，内容包括，将MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金标的指数由MSCI中国A股指数变更为MSCI中国A股国际通指数以及相应修订基金合同等。基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，决议生效后的三十个开放日内，原合同《MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效，《华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，2018年9月17日MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金正式变更为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金。

## 七、基金的存续

《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。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的交易

### （一）基金在上海证券交易所的交易

基金在上海证券交易所的上市交易需遵照《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。MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金于2015年3月25日起在上海证券交易所上市交易（场内简称：MSCIA股；交易代码：512990）。MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更注册为本基金不影响基金在上海证券交易所的交易。

### （二）IOPV的计算

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，中证指数有限公司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为:

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额+申购赎回清单中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用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中的预估现金部分)/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。

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。

(三)基金在上海证券交易所终止上市交易的情形

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基金的上市交易,并报中国证监会备案:

- 1、不再具备本条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。

若因上述 1、3、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,在不违反法律法规的前提下,履行适当程序后,本基金可由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金,届时,基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回业务规则。

(四)法律法规、监管部门或上海证券交易所对上市交易另有规定的,从其规定。

(五)在不违反法律法规的前提下,本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易,无需召开基金份额持有人大会。

## 九、基金份额的申购与赎回

本基金的基金份额分为场内份额与场外份额两种,分别适用不同的申购赎回办法。在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人可根据市场情况停止办理

场外或场内申购赎回业务，并提前公告。

（一）申购和赎回场所

1、场内申购赎回

对于在场内申购赎回的投资人，应当在场内申购赎回代理机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理机构提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。本基金场内申购赎回代理机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“（一）基金份额销售机构”的相关描述。

2、场外申购赎回

对于在场外申购赎回的投资人，应当在基金管理人或其指定的其他销售机构办理本基金的申购和赎回。

投资者可通过本公司北京分公司及设在北京、上海、广州的投资理财中心办理场外申购赎回相关业务。

（1）北京分公司

地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）

电话：010-88087226

传真：010-88066028

（2）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街29号东环广场B座一层（100027）

电话：010-64185183

传真：010-64185180

（3）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路9号（新科祥园小区大门口一层）（100190）

电话：010-82523198

传真：010-82523196

（4）北京东四环投资理财中心

地址：北京市朝阳区八里庄西里100号住邦2000商务中心1号楼一层（100025）

电话：010-85869755

传真：010-85869575

（5）北京望京投资理财中心

地址：北京市朝阳区望京宏泰东街绿地中国锦103（100102）

电话：010- 64709882

传真：010- 64702330

（6）上海静安嘉里投资理财中心

地址：上海市静安区南京西路1515号静安嘉里中心办公楼一座2608单元（200040）

电话：021-60735022

传真：021-60735010

（7）广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区珠江西路5号5306房（510623）

电话：020-38460001

传真：020-38067182

3、基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回的销售机构，并在基金管理人网站公示，也可根据实际情况停止办理场内或场外申购赎回业务，并予以公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

场外投资人在开放日办理场外基金份额的申购和赎回，场外申购和赎回截止时间为开放日的 14:00，基金管理人可根据实际情况需要调整，具体办理时间以基金管理人的规定为准；但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。本基金场外申购赎回的开放时间与场内申购赎回的开放时间存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或实际情况需要，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

本基金已于 2018 年 9 月 17 日起开始办理日常申购、赎回业务。

本基金场外申购赎回的开始时间与场内申购赎回的开始时间可能存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告。

（三）申购与赎回的原则



1、基金场内、场外股票申购与赎回采用“份额申购、份额赎回”原则，即申购、赎回均以份额申请；场外现金申购与赎回采用“金额申购、份额赎回”的方式，即申购以金额申请、赎回以份额申请。

2、基金场内、场外股票申购与赎回的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；场外现金申购与赎回的申购对价、赎回对价为现金。

3、场内及场外股票申购、赎回申请提交后不得撤销；当日的场外现金申购、赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销。

4、场内申购、赎回应遵守《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》的规定。场外申购、赎回应遵守基金管理人的相关业务规则。

5、场外份额可通过现金方式及股票方式申购与赎回。场外现金申购赎回遵循“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。若出现极端的市場情况（如指数或成份股停牌或组合中的部分股票流动性受限等），为了保护基金份额持有人的利益，管理人可根据当时的市場情况、场外申赎的交易情况，对场外现金申购、赎回价格进行调整（如将场外现金申购、赎回价格由份额净值调整为代理买卖价格），以更好地反映实际交易成本。

6、场外份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

7、条件许可情况下，本基金场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管，也可跨系统转托管为场内份额，但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

8、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、场内申购与赎回的程序

###### （1）申购和赎回的申请方式

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

投资人申购基金份额时，必须根据相应的申购赎回清单备足申购对价。

投资人在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵

守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

### （2）申购和赎回申请的确认

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

投资人可在申请当日及时通过其办理申购、赎回的销售网点或以销售网点规定的其他方式查询有关申请的确认情况。投资人应及时查询有关申请的确认情况。

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；投资者赎回获得的股票当日可卖出。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。投资者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《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》和参与各方相关协议的有关规定。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，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购当日并卖出的基金份额及对应的深交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交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，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交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。

投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与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机构、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。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上交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机构、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成

份股现金替代的交付。

如果登记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《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》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

基金管理人、登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并最迟于开始实施前在至少一种指定媒介公告。

## 2、场外现金申购与赎回的程序

### （1）申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金管理人规定的程序，在场外申购赎回开放日的开放时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须全额交付申购款项，并在规定的截止时间前划到销售机构指定的账户上，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

### （2）申购和赎回申请的确认

基金管理人以事先规定的截止时间前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日对该交易的有效性进行确认。申购、赎回的确认以基金登记机构的确认结果为准。

### （3）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定的截止时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金管理人将在接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生暂停赎回或延缓支付赎回款的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### （4）申购和赎回的登记

正常情况下，投资者 T 日申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日起有权申请赎回该部分基金份额，或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管。

基金份额持有人 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

### （5）申购和赎回的投资交易

对于 T 日截止时间前收到的有效申购及有效赎回申请，基金管理人将根据轧差之后的净申购或净赎回数额，采用算法交易系统，按尽可能贴近收盘价的原则，在 T 日完成相应的证券交易。

在法律法规允许的范围内，登记机构可以对上述业务办理时间及规则进行调整，并提前公告。

### 3、场外股票申购与赎回的程序

投资者需按照销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。申购基金份额时，须根据申购赎回清单备足申购对价；赎回基金份额时，须持有足够的基金份额余额和现金。申购、赎回份额的确认以基金登记机构的确认结果为准。

### （五）申购和赎回的数额限制

#### 1、场内、场外股票申购与赎回的数额限制

投资者场内、场外股票申购与赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。目前，本基金最小申购、赎回单位为 300 万份。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。

#### 2、场外现金申购与赎回的数额限制

（1）投资者每次申购的单笔最低金额为人民币 300 万元，每次赎回的单笔最低份额为 300 万份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的场外份额余额不足 300 万份的，在赎回时需一次全部赎回。具体业务办理请遵循各销售机构的相关规定。

（2）基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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数额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

### （六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、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 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 2、场内及场外股票申购、赎回的对价及费用

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

（2）T 日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

（3）投资者办理场内申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。投资者办理场外股票申购、赎回暂不收取申购费与赎回费。

## 3、场外现金申购、赎回的价格及费用

（1）申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额计算结果均按四舍五入方法，保留到整数位，申购费用以人民币元为单位，四舍五入保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回相关费用（如有），赎回金额、赎回费用的单位为人民币元，四舍五入保留到小数点两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（3）投资者在申购或赎回基金份额时，基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平，收取一定的申购费和/或赎回费并归入基金资产，确保覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。

当前的申购、赎回费率如下：

申购费率：0.05%

赎回费率：0.15%

本基金的申购费由申购人承担，赎回费由赎回人承担，申购费与赎回费均全部归入基金资产。

基金管理人可根据市场情况调整申购费率、赎回费率，并及时公告。

### （4）申购份额、赎回金额的计算方式

#### ① 申购份额的计算

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

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

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

## ②赎回金额的计算

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

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

4、由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

## （七）申购赎回清单的内容与格式

申购、赎回清单适用于本基金的场内申购、赎回业务及场外股票申购、赎回业务。投资者办理场外股票申购、赎回业务时适用的申购赎回清单参照基金管理人公告的相应基金场内申购、赎回业务的申购赎回清单，二者差异为对于场内申购赎回清单中标志为“退补现金替代”的股票，场外股票申购、赎回业务对应的申购赎回清单中标志为“可以现金替代”。

### 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内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金部分、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

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

（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交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

## （2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

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

## ③替代金额的处理程序

投资者办理场内申购、赎回业务，T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

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

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期

间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

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

投资者办理场外股票申购、赎回业务，基金管理人将按照申购日替代证券的估值与替代金额的差额确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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：

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

场外股票申购赎回暂不设置现金替代比例上限。

### （3）必须现金替代

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

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。

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。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交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进行的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，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 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机构预先冻结申请申购赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金部分。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现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购赎回清单中各可以现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和）

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：

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

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

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

#### 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                  | 201*-*-* (T 日)        |      |          |          |           |
| 基金名称                    | 华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF |      |          |          |           |
| 基金管理公司名称                | 华夏基金管理有限公司            |      |          |          |           |
| 一级市场基金代码                | 512991                |      |          |          |           |
| 201*年*月*日 (T-1 日) 信息内容  |                       |      |          |          |           |
| 现金差额 (单位: 元)            | 7,800.51              |      |          |          |           |
| 最小申购赎回单位资产净值 (单位: 元)    | 3,564,026.51          |      |          |          |           |
| 基金份额净值 (单位: 元)          | 1.1880                |      |          |          |           |
| 201*年*月*日 (T 日) 信息内容    |                       |      |          |          |           |
| 预估现金部分 (单位: 元)          | 7,715.51              |      |          |          |           |
| 可以现金替代比例上限              | 50%                   |      |          |          |           |
| 是否需要公布 IOPV             | 是                     |      |          |          |           |
| 最小申购赎回单位 (单位: 份)        | 3,000,000             |      |          |          |           |
| 申购、赎回的允许情况              | 允许申购和赎回               |      |          |          |           |
| 201*年*月*日 (T 日) 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                  | 2100 | 深市退补现金替代 | 10.0%    | 32802.000 |
| 000002                  | 万科 A                  | 1200 | 深市退补现金替代 | 10.0%    | 34020.000 |
| 000027                  | 深圳能源                  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0%    | 2376.000  |

|        |        |      |          |       |           |
|--------|--------|------|----------|-------|-----------|
| 000028 | 国药一致   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4316.000  |
| 000031 | 大悦城    | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2109.000  |
| 000039 | 中集集团   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1880.000  |
| 000046 | 泛海控股   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1708.000  |
| 000050 | 深天马 A  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4437.000  |
| 000060 | 中金岭南   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1596.000  |
| 000063 | 中兴通讯   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 12160.000 |
| 000066 | 中国长城   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3020.000  |
| 000069 | 华侨城 A  | 1000 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7080.000  |
| 000089 | 深圳机场   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1888.000  |
| 000100 | TCL 集团 | 1700 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6358.000  |
| 000157 | 中联重科   | 800  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4888.000  |
| 000166 | 申万宏源   | 2800 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 13440.000 |
| 000333 | 美的集团   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 22624.000 |
| 000338 | 潍柴动力   | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9366.000  |
| 000401 | 冀东水泥   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1491.000  |
| 000402 | 金融街    | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3068.000  |
| 000413 | 东旭光电   | 800  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3840.000  |
| 000415 | 渤海租赁   | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1740.000  |
| 000423 | 东阿阿胶   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3390.000  |
| 000425 | 徐工机械   | 900  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4077.000  |
| 000503 | 国新健康   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1642.000  |
| 000513 | 丽珠集团   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3046.000  |
| 000538 | 云南白药   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9113.000  |
| 000559 | 万向钱潮   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2004.000  |
| 000568 | 泸州老窖   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 17060.000 |
| 000581 | 威孚高科   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1840.000  |
| 000596 | 古井贡酒   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 11329.000 |
| 000598 | 兴蓉环境   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 898.000   |
| 000623 | 吉林敖东   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1529.000  |
| 000625 | 长安汽车   | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4425.000  |
| 000627 | 天茂集团   | 600  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4020.000  |
| 000629 | 攀钢钒钛   | 600  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1704.000  |
| 000630 | 铜陵有色   | 1300 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2808.000  |
| 000651 | 格力电器   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 23416.000 |
| 000656 | 金科股份   | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4690.000  |
| 000661 | 长春高新   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 46285.000 |
| 000671 | 阳光城    | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2067.000  |
| 000681 | 视觉中国   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2045.000  |
| 000686 | 东北证券   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1562.000  |
| 000703 | 恒逸石化   | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5476.000  |
| 000709 | 河钢股份   | 1400 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3570.000  |
| 000723 | 美锦能源   | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2448.000  |

|        |       |      |          |       |           |
|--------|-------|------|----------|-------|-----------|
| 000725 | 京东方 A | 4200 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 16212.000 |
| 000728 | 国元证券  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3372.000  |
| 000729 | 燕京啤酒  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1182.000  |
| 000732 | 泰禾集团  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1152.000  |
| 000738 | 航发控制  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1286.000  |
| 000750 | 国海证券  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1362.000  |
| 000768 | 中航飞机  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6388.000  |
| 000776 | 广发证券  | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9366.000  |
| 000778 | 新兴铸管  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1176.000  |
| 000783 | 长江证券  | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4445.000  |
| 000786 | 北新建材  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2278.000  |
| 000825 | 太钢不锈  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1600.000  |
| 000826 | 启迪环境  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1694.000  |
| 000830 | 鲁西化工  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 928.000   |
| 000839 | 中信国安  | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1680.000  |
| 000858 | 五粮液   | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 65360.000 |
| 000860 | 顺鑫农业  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5250.000  |
| 000876 | 新希望   | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 10750.000 |
| 000883 | 湖北能源  | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2005.000  |
| 000895 | 双汇发展  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9639.000  |
| 000898 | 鞍钢股份  | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2177.000  |
| 000932 | 华菱钢铁  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1365.000  |
| 000938 | 紫光股份  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5628.000  |
| 000960 | 锡业股份  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 974.000   |
| 000961 | 中南建设  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2529.000  |
| 000963 | 华东医药  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5120.000  |
| 000975 | 银泰黄金  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1226.000  |
| 000977 | 浪潮信息  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2939.000  |
| 000983 | 西山煤电  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2332.000  |
| 000997 | 新大陆   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1487.000  |
| 000998 | 隆平高科  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1239.000  |
| 000999 | 华润三九  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2995.000  |
| 001979 | 招商蛇口  | 900  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 17127.000 |
| 002001 | 新和成   | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4410.000  |
| 002007 | 华兰生物  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3459.000  |
| 002010 | 传化智联  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2788.000  |
| 002013 | 中航机电  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1908.000  |
| 002019 | 亿帆医药  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1350.000  |
| 002024 | 苏宁易购  | 1200 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 12072.000 |
| 002027 | 分众传媒  | 1800 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 10476.000 |
| 002032 | 苏泊尔   | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7246.000  |
| 002038 | 双鹭药业  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1246.000  |
| 002044 | 美年健康  | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7965.000  |

|        |      |      |          |       |           |
|--------|------|------|----------|-------|-----------|
| 002049 | 紫光国微 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4410.000  |
| 002050 | 三花智控 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3010.000  |
| 002065 | 东华软件 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3660.000  |
| 002074 | 国轩高科 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1219.000  |
| 002078 | 太阳纸业 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1770.000  |
| 002081 | 金螳螂  | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3204.000  |
| 002085 | 万丰奥威 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1358.000  |
| 002092 | 中泰化学 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1272.000  |
| 002110 | 三钢闽光 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1712.000  |
| 002120 | 韵达股份 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6106.000  |
| 002124 | 天邦股份 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1316.000  |
| 002127 | 南极电商 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1992.000  |
| 002129 | 中环股份 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1998.000  |
| 002142 | 宁波银行 | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 18823.000 |
| 002146 | 荣盛发展 | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4345.000  |
| 002152 | 广电运通 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1560.000  |
| 002153 | 石基信息 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3710.000  |
| 002157 | 正邦科技 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3028.000  |
| 002174 | 游族网络 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1595.000  |
| 002179 | 中航光电 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3900.000  |
| 002180 | 纳思达  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2937.000  |
| 002195 | 二三四五 | 1700 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5134.000  |
| 002202 | 金风科技 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4812.000  |
| 002217 | 合力泰  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 948.000   |
| 002223 | 鱼跃医疗 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1919.000  |
| 002230 | 科大讯飞 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9966.000  |
| 002236 | 大华股份 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6952.000  |
| 002241 | 歌尔股份 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7552.000  |
| 002268 | 卫士通  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2374.000  |
| 002271 | 东方雨虹 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2494.000  |
| 002281 | 光迅科技 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2810.000  |
| 002294 | 信立泰  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1797.000  |
| 002299 | 圣农发展 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2464.000  |
| 002304 | 洋河股份 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 20076.000 |
| 002311 | 海大集团 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3180.000  |
| 002340 | 格林美  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1245.000  |
| 002352 | 顺丰控股 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7782.000  |
| 002353 | 杰瑞股份 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3199.000  |
| 002371 | 北方华创 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7150.000  |
| 002372 | 伟星新材 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1201.000  |
| 002373 | 千方科技 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1672.000  |
| 002384 | 东山精密 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3756.000  |
| 002385 | 大北农  | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2170.000  |

|        |      |      |          |       |           |
|--------|------|------|----------|-------|-----------|
| 002387 | 维信诺  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1577.000  |
| 002399 | 海普瑞  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1764.000  |
| 002405 | 四维图新 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3120.000  |
| 002410 | 广联达  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3469.000  |
| 002414 | 高德红外 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1965.000  |
| 002415 | 海康威视 | 1200 | 深市退补现金替代 | 10.0% | 38400.000 |
| 002422 | 科伦药业 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4818.000  |
| 002424 | 贵州百灵 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 842.000   |
| 002439 | 启明星辰 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3141.000  |
| 002456 | 欧菲光  | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3732.000  |
| 002460 | 赣锋锂业 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2666.000  |
| 002463 | 沪电股份 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2116.000  |
| 002465 | 海格通信 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2994.000  |
| 002466 | 天齐锂业 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2930.000  |
| 002475 | 立讯精密 | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 23310.000 |
| 002493 | 荣盛石化 | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6065.000  |
| 002500 | 山西证券 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2232.000  |
| 002506 | 协鑫集成 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2528.000  |
| 002507 | 涪陵榨菜 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2471.000  |
| 002508 | 老板电器 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3114.000  |
| 002555 | 三七互娱 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6861.000  |
| 002558 | 巨人网络 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3554.000  |
| 002563 | 森马服饰 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1944.000  |
| 002572 | 索菲亚  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1716.000  |
| 002583 | 海能达  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 854.000   |
| 002594 | 比亚迪  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 8920.000  |
| 002600 | 领益智造 | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5230.000  |
| 002601 | 龙蟠佰利 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2656.000  |
| 002603 | 以岭药业 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1129.000  |
| 002624 | 完美世界 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3470.000  |
| 002673 | 西部证券 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3552.000  |
| 002690 | 美亚光电 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3771.000  |
| 002714 | 牧原股份 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 18200.000 |
| 002736 | 国信证券 | 500  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5745.000  |
| 002739 | 万达电影 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2930.000  |
| 002773 | 康弘药业 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3316.000  |
| 002797 | 第一创业 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2864.000  |
| 002812 | 恩捷股份 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4005.000  |
| 002821 | 凯莱英  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 12700.000 |
| 002916 | 深南电路 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 14488.000 |
| 002926 | 华西证券 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2832.000  |
| 300003 | 乐普医疗 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6880.000  |
| 300012 | 华测检测 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1386.000  |

|        |      |      |          |       |           |
|--------|------|------|----------|-------|-----------|
| 300014 | 亿纬锂能 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4514.000  |
| 300015 | 爱尔眼科 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 16776.000 |
| 300017 | 网宿科技 | 300  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2625.000  |
| 300024 | 机器人  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1343.000  |
| 300033 | 同花顺  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9200.000  |
| 300059 | 东方财富 | 800  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 11112.000 |
| 300070 | 碧水源  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1480.000  |
| 300072 | 三聚环保 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1210.000  |
| 300122 | 智飞生物 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 9016.000  |
| 300124 | 汇川技术 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5444.000  |
| 300136 | 信维通信 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3822.000  |
| 300142 | 沃森生物 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6280.000  |
| 300144 | 宋城演艺 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5632.000  |
| 300146 | 汤臣倍健 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1565.000  |
| 300207 | 欣旺达  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1639.000  |
| 300251 | 光线传媒 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2034.000  |
| 300253 | 卫宁健康 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1538.000  |
| 300285 | 国瓷材料 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 2301.000  |
| 300296 | 利亚德  | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1242.000  |
| 300308 | 中际旭创 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4280.000  |
| 300347 | 泰格医药 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6336.000  |
| 300357 | 我武生物 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4700.000  |
| 300383 | 光环新网 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 1903.000  |
| 300408 | 三环集团 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3492.000  |
| 300413 | 芒果超媒 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6312.000  |
| 300433 | 蓝思科技 | 400  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 4952.000  |
| 300450 | 先导智能 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3850.000  |
| 300454 | 深信服  | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 11954.000 |
| 300498 | 温氏股份 | 700  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 24920.000 |
| 300529 | 健帆生物 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 8000.000  |
| 300558 | 贝达药业 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7311.000  |
| 300595 | 欧普康视 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 5231.000  |
| 300601 | 康泰生物 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 8095.000  |
| 300628 | 亿联网络 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 7171.000  |
| 300676 | 华大基因 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 6065.000  |
| 300699 | 光威复材 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 3897.000  |
| 300750 | 宁德时代 | 200  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 17600.000 |
| 300760 | 迈瑞医疗 | 100  | 深市退补现金替代 | 10.0% | 18465.000 |
| 600000 | 浦发银行 | 3700 | 允许       | 10.0% |           |
| 600004 | 白云机场 | 200  | 允许       | 10.0% |           |
| 600009 | 上海机场 | 100  | 允许       | 10.0% |           |
| 600010 | 包钢股份 | 5700 | 允许       | 10.0% |           |
| 600011 | 华能国际 | 600  | 允许       | 10.0% |           |



|        |      |      |    |       |  |
|--------|------|------|----|-------|--|
| 600015 | 华夏银行 | 1600 | 允许 | 10.0% |  |
| 600016 | 民生银行 | 4400 | 允许 | 10.0% |  |
| 600018 | 上港集团 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 600019 | 宝钢股份 | 2300 | 允许 | 10.0% |  |
| 600021 | 上海电力 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600026 | 中远海能 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600027 | 华电国际 | 900  | 允许 | 10.0% |  |
| 600028 | 中国石化 | 3200 | 允许 | 10.0% |  |
| 600029 | 南方航空 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 600030 | 中信证券 | 1200 | 允许 | 10.0% |  |
| 600031 | 三一重工 | 1000 | 允许 | 10.0% |  |
| 600036 | 招商银行 | 2600 | 允许 | 10.0% |  |
| 600038 | 中直股份 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600048 | 保利地产 | 1500 | 允许 | 10.0% |  |
| 600050 | 中国联通 | 3900 | 允许 | 10.0% |  |
| 600056 | 中国医药 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600061 | 国投资本 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600062 | 华润双鹤 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600066 | 宇通客车 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600068 | 葛洲坝  | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 600085 | 同仁堂  | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600089 | 特变电工 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600104 | 上汽集团 | 1000 | 允许 | 10.0% |  |
| 600109 | 国金证券 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600111 | 北方稀土 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600115 | 东方航空 | 1200 | 允许 | 10.0% |  |
| 600118 | 中国卫星 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600132 | 重庆啤酒 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600153 | 建发股份 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600160 | 巨化股份 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600161 | 天坛生物 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600170 | 上海建工 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 600176 | 中国巨石 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600183 | 生益科技 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600188 | 兖州煤业 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600196 | 复星医药 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600201 | 生物股份 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600208 | 新湖中宝 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 600219 | 南山铝业 | 1000 | 允许 | 10.0% |  |
| 600256 | 广汇能源 | 900  | 允许 | 10.0% |  |
| 600258 | 首旅酒店 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600260 | 凯乐科技 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600271 | 航天信息 | 200  | 允许 | 10.0% |  |

|        |      |      |    |       |          |
|--------|------|------|----|-------|----------|
| 600273 | 嘉化能源 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600276 | 恒瑞医药 | 600  | 允许 | 10.0% |          |
| 600282 | 南钢股份 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 600297 | 广汇汽车 | 1000 | 允许 | 10.0% |          |
| 600298 | 安琪酵母 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600309 | 万华化学 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 600315 | 上海家化 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600332 | 白云山  | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600340 | 华夏幸福 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 600346 | 恒力石化 | 700  | 允许 | 10.0% |          |
| 600352 | 浙江龙盛 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 600362 | 江西铜业 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 600369 | 西南证券 | 700  | 允许 | 10.0% |          |
| 600372 | 中航电子 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600373 | 中文传媒 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600376 | 首开股份 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600380 | 健康元  | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600383 | 金地集团 | 600  | 允许 | 10.0% |          |
| 600392 | 盛和资源 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600398 | 海澜之家 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 600406 | 国电南瑞 | 600  | 允许 | 10.0% |          |
| 600415 | 小商品城 | 700  | 允许 | 10.0% |          |
| 600426 | 华鲁恒升 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600436 | 片仔癀  | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600438 | 通威股份 | 500  | 允许 | 10.0% |          |
| 600446 | 金证股份 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600460 | 士兰微  | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600466 | 蓝光发展 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600482 | 中国动力 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600486 | 扬农化工 | 100  | 必须 | 10.0% | 5684.000 |
| 600487 | 亨通光电 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600489 | 中金黄金 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 600498 | 烽火通信 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600500 | 中化国际 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600511 | 国药股份 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600516 | 方大炭素 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 600519 | 贵州茅台 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600521 | 华海药业 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600522 | 中天科技 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600528 | 中铁工业 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600535 | 天士力  | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 600536 | 中国软件 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 600547 | 山东黄金 | 300  | 允许 | 10.0% |          |

|        |      |      |    |       |  |
|--------|------|------|----|-------|--|
| 600549 | 厦门钨业 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600566 | 济川药业 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600567 | 山鹰纸业 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600570 | 恒生电子 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600572 | 康恩贝  | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600582 | 天地科技 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600583 | 海油工程 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600584 | 长电科技 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600585 | 海螺水泥 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600588 | 用友网络 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600598 | 北大荒  | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600600 | 青岛啤酒 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600606 | 绿地控股 | 1000 | 允许 | 10.0% |  |
| 600637 | 东方明珠 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600642 | 申能股份 | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 600643 | 爱建集团 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600648 | 外高桥  | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600655 | 豫园股份 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600660 | 福耀玻璃 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600673 | 东阳光  | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600674 | 川投能源 | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 600675 | 中华企业 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600688 | 上海石化 | 700  | 允许 | 10.0% |  |
| 600690 | 海尔智家 | 800  | 允许 | 10.0% |  |
| 600699 | 均胜电子 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600703 | 三安光电 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600704 | 物产中大 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600705 | 中航资本 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 600733 | 北汽蓝谷 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600739 | 辽宁成大 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600741 | 华域汽车 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600754 | 锦江酒店 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600760 | 中航沈飞 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600763 | 通策医疗 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600777 | 新潮能源 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600779 | 水井坊  | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600782 | 新钢股份 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600795 | 国电电力 | 2500 | 允许 | 10.0% |  |
| 600801 | 华新水泥 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600808 | 马钢股份 | 800  | 允许 | 10.0% |  |
| 600809 | 山西汾酒 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600816 | 安信信托 | 700  | 允许 | 10.0% |  |
| 600820 | 隧道股份 | 400  | 允许 | 10.0% |  |

|        |      |      |    |       |  |
|--------|------|------|----|-------|--|
| 600835 | 上海机电 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600837 | 海通证券 | 1000 | 允许 | 10.0% |  |
| 600845 | 宝信软件 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600848 | 上海临港 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600863 | 内蒙华电 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600867 | 通化东宝 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600872 | 中炬高新 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600875 | 东方电气 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 600879 | 航天电子 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600885 | 宏发股份 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600886 | 国投电力 | 800  | 允许 | 10.0% |  |
| 600887 | 伊利股份 | 800  | 允许 | 10.0% |  |
| 600893 | 航发动力 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 600895 | 张江高科 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600900 | 长江电力 | 2800 | 允许 | 10.0% |  |
| 600909 | 华安证券 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 600919 | 江苏银行 | 1400 | 允许 | 10.0% |  |
| 600926 | 杭州银行 | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 600958 | 东方证券 | 800  | 允许 | 10.0% |  |
| 600967 | 内蒙一机 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 600977 | 中国电影 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600998 | 九州通  | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 600999 | 招商证券 | 700  | 允许 | 10.0% |  |
| 601000 | 唐山港  | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 601006 | 大秦铁路 | 1900 | 允许 | 10.0% |  |
| 601009 | 南京银行 | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 601012 | 隆基股份 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 601018 | 宁波港  | 1100 | 允许 | 10.0% |  |
| 601021 | 春秋航空 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 601066 | 中信建投 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 601088 | 中国神华 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 601098 | 中南传媒 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 601099 | 太平洋  | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 601100 | 恒立液压 | 100  | 允许 | 10.0% |  |
| 601108 | 财通证券 | 400  | 允许 | 10.0% |  |
| 601111 | 中国国航 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 601117 | 中国化学 | 600  | 允许 | 10.0% |  |
| 601128 | 常熟银行 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 601138 | 工业富联 | 500  | 允许 | 10.0% |  |
| 601155 | 新城控股 | 300  | 允许 | 10.0% |  |
| 601166 | 兴业银行 | 2600 | 允许 | 10.0% |  |
| 601168 | 西部矿业 | 200  | 允许 | 10.0% |  |
| 601169 | 北京银行 | 2600 | 允许 | 10.0% |  |

|        |      |      |    |       |          |
|--------|------|------|----|-------|----------|
| 601186 | 中国铁建 | 1400 | 允许 | 10.0% |          |
| 601198 | 东兴证券 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601211 | 国泰君安 | 900  | 允许 | 10.0% |          |
| 601216 | 君正集团 | 1100 | 允许 | 10.0% |          |
| 601225 | 陕西煤业 | 1100 | 允许 | 10.0% |          |
| 601229 | 上海银行 | 1800 | 允许 | 10.0% |          |
| 601231 | 环旭电子 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 601233 | 桐昆股份 | 100  | 允许 | 10.0% |          |
| 601238 | 广汽集团 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601288 | 农业银行 | 9300 | 允许 | 10.0% |          |
| 601318 | 中国平安 | 1400 | 允许 | 10.0% |          |
| 601328 | 交通银行 | 4900 | 允许 | 10.0% |          |
| 601333 | 广深铁路 | 700  | 允许 | 10.0% |          |
| 601336 | 新华保险 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601360 | 三六零  | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 601377 | 兴业证券 | 900  | 允许 | 10.0% |          |
| 601390 | 中国中铁 | 2300 | 允许 | 10.0% |          |
| 601398 | 工商银行 | 6800 | 允许 | 10.0% |          |
| 601555 | 东吴证券 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 601598 | 中国外运 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601600 | 中国铝业 | 1600 | 允许 | 10.0% |          |
| 601601 | 中国太保 | 800  | 允许 | 10.0% |          |
| 601607 | 上海医药 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 601618 | 中国中冶 | 2300 | 允许 | 10.0% |          |
| 601628 | 中国人寿 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601668 | 中国建筑 | 5300 | 允许 | 10.0% |          |
| 601669 | 中国电建 | 1600 | 允许 | 10.0% |          |
| 601688 | 华泰证券 | 900  | 允许 | 10.0% |          |
| 601699 | 潞安环能 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 601727 | 上海电气 | 1000 | 允许 | 10.0% |          |
| 601766 | 中国中车 | 3100 | 允许 | 10.0% |          |
| 601788 | 光大证券 | 500  | 允许 | 10.0% |          |
| 601799 | 星宇股份 | 100  | 必须 | 10.0% | 8453.000 |
| 601800 | 中国交建 | 400  | 允许 | 10.0% |          |
| 601818 | 光大银行 | 5000 | 允许 | 10.0% |          |
| 601838 | 成都银行 | 500  | 允许 | 10.0% |          |
| 601857 | 中国石油 | 2000 | 允许 | 10.0% |          |
| 601866 | 中远海发 | 1000 | 允许 | 10.0% |          |
| 601872 | 招商轮船 | 500  | 允许 | 10.0% |          |
| 601877 | 正泰电器 | 300  | 允许 | 10.0% |          |
| 601878 | 浙商证券 | 200  | 允许 | 10.0% |          |
| 601880 | 大连港  | 500  | 允许 | 10.0% |          |
| 601888 | 中国国旅 | 200  | 允许 | 10.0% |          |

|        |      |      |    |       |           |
|--------|------|------|----|-------|-----------|
| 601899 | 紫金矿业 | 2400 | 允许 | 10.0% |           |
| 601901 | 方正证券 | 1000 | 允许 | 10.0% |           |
| 601919 | 中远海控 | 800  | 允许 | 10.0% |           |
| 601933 | 永辉超市 | 1200 | 允许 | 10.0% |           |
| 601939 | 建设银行 | 1200 | 允许 | 10.0% |           |
| 601958 | 金钼股份 | 300  | 允许 | 10.0% |           |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 601985 | 中国核电 | 1600 | 允许 | 10.0% |           |
| 601988 | 中国银行 | 4400 | 允许 | 10.0% |           |
| 601989 | 中国重工 | 2900 | 允许 | 10.0% |           |
| 601990 | 南京证券 | 300  | 允许 | 10.0% |           |
| 601992 | 金隅集团 | 1100 | 允许 | 10.0% |           |
| 601997 | 贵阳银行 | 400  | 允许 | 10.0% |           |
| 601998 | 中信银行 | 700  | 允许 | 10.0% |           |
| 603019 | 中科曙光 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603077 | 和邦生物 | 700  | 允许 | 10.0% |           |
| 603156 | 养元饮品 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603160 | 汇顶科技 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603259 | 药明康德 | 200  | 允许 | 10.0% |           |
| 603288 | 海天味业 | 300  | 允许 | 10.0% |           |
| 603338 | 浙江鼎力 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603369 | 今世缘  | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603444 | 吉比特  | 100  | 必须 | 10.0% | 31175.000 |
| 603501 | 韦尔股份 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603517 | 绝味食品 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603589 | 口子窖  | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603658 | 安图生物 | 100  | 必须 | 10.0% | 10389.000 |
| 603707 | 健友股份 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603799 | 华友钴业 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603833 | 欧派家居 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603858 | 步长制药 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603866 | 桃李面包 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603882 | 金域医学 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603883 | 老百姓  | 100  | 必须 | 10.0% | 6721.000  |
| 603885 | 吉祥航空 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603899 | 晨光文具 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603939 | 益丰药房 | 100  | 允许 | 10.0% |           |
| 603986 | 兆易创新 | 100  | 必须 | 10.0% | 16287.000 |
| 603993 | 洛阳钼业 | 2300 | 允许 | 10.0% |           |

（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运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。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。

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

4、相关证券交易所、登记机构、申购赎回代理机构等因异常情况无法办理申购业务。

5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。

6、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。

7、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

8、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，或证券市场价格发生大幅波动，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

10、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1-8 项暂停申购情形时，基金管理人应当及时公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内和场外两种申购方式，也可以只拒绝或暂停其中一种方式。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、相关证券交易所、登记机构、申购赎回代理机构等因异常情况无法办理赎回业务。

- 5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
- 6、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。
- 7、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。
- 8、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应及时公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

基金管理人可同时在场内和场外两种赎回方式实施暂停或延缓支付赎回款项，也可以只针对其中一种方式。

#### （十）场外巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的场外基金份额净赎回申请（场外赎回申请份额总数减去场外申购申请份额总数）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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



（4）如果基金发生场外巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30% 以上的大额场外赎回申请情形下，如果基金管理人认为支付全部投资人的场外赎回申请有困难或认为因支付全部投资人的场外赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理场外赎回申请。具体分为两种情况：

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部场外赎回申请，为了保护其他场外赎回投资人的利益，对于其他投资人的场外赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过基金总份额 30% 以上的大额场外赎回申请，基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的场外赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延期的场外赎回申请与下一开放日场外赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交场外赎回申请时选择取消赎回的，则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的场外赎回申请也有困难时，则所有投资人的场外赎回申请（包括单个投资人超过基金总份额 30% 以上的大额场外赎回申请和其他投资人的场外赎回申请）都按照上述“（2）部分延期赎回”的约定一并办理。

### 3、巨额赎回的公告

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

#### （十一）其他申购赎回方式

1、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。

2、ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，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。若本基金推出联接基金，在基金合同生效后，可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，申购价格为申购日本基金基金份额净值，不收取申购费用。

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、如果上海证券交易所推出 ETF 分级业务，在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可为本基金增设分级份额。基金管理人可就分级后

的全部或部分份额申请上市，并制定、公布相应的业务规则。

5、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并公告。

#### （十二）基金份额折算

为提高交易便利或根据需要（如变更标的指数），基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。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。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。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

#### （十三）基金份额的非交易过户等其他业务

基金登记机构可依据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

#### （十四）基金的登记及转托管

##### 1、基金份额的登记

本基金份额采用分系统登记的原则。投资者通过二级市场买入或场内申购的基金份额属场内份额，由中国证券登记结算有限公司负责办理登记结算；投资者通过场外现金申购的基金份额属场外份额，由基金管理人负责办理登记结算；投资者通过场外股票申购的基金份额由中国证券登记结算有限公司负责办理登记结算。

##### 2、基金份额的转托管

本基金的转托管包括场外份额的系统内转托管及场内外份额的跨系统转托管。

条件许可情况下，在基金管理人制定并发布有关规则后，本基金场外份额可跨系统转托管为场内份额，并进行场内赎回、上市交易。但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

（十五）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。

## 十、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最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。

## （二）标的指数

本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数。

如果指数发布机构变更或停止 MSCI 中国 A 股国际通指数的编制及发布、或 MSCI 中国 A 股国际通指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致 MSCI 中国 A 股国际通指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数、业绩基准和基金名称，并及时公告。

## （三）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债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）。

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。

基金投资于跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

## （四）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

### 1、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

### 2、替代性策略

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。

### 3、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

#### 4、国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。

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。

### （五）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。
- （2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。
- （3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%。
- （4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。
- （5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%。
- （6）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。
- （7）本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。
- （8）基金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。
- （9）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期。
- （10）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净

值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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）应符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。

（11）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

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

（13）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

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

（15）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。

（16）法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除第（7）、（14）、（15）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，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。期间，基金的投资范围、投资策略应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) 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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### （六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人在履行适当程序后，可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

#### （七）风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

#### （八）基金的融资、融券、转融通

本基金履行适当的程序后，可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资、融券以及参与转融通等相关业务。

#### （十二）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2019 年第 2 季度报告：

##### “5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)          | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 516,672,254.97 | 96.42            |
|    | 其中：股票  | 516,672,254.97 | 96.42            |
| 2  | 固定收益投资 | -              | -                |
|    | 其中：债券  | -              | -                |
|    | 资产支持证券 | -              | -                |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 17,502,841.07  | 3.27   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,677,283.39   | 0.31   |
| 8 | 合计                | 535,852,379.43 | 100.00 |

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 6,725,983.22   | 1.26         |
| B  | 采矿业              | 20,110,919.67  | 3.76         |
| C  | 制造业              | 201,820,179.33 | 37.77        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,785,127.32  | 2.77         |
| E  | 建筑业              | 15,207,131.46  | 2.85         |
| F  | 批发和零售业           | 9,707,364.40   | 1.82         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 14,308,559.01  | 2.68         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,493,723.15  | 4.02         |
| J  | 金融业              | 171,257,032.04 | 32.05        |
| K  | 房地产业             | 26,084,108.93  | 4.88         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,343,704.00   | 1.37         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 415,833.30     | 0.08         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 4,274,988.70   | 0.80         |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,137,600.44   | 0.59  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 516,672,254.97 | 96.68 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 31,175    | 30,676,200.00 | 5.74         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 268,638   | 23,804,013.18 | 4.45         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 511,552   | 18,405,640.96 | 3.44         |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 96,229    | 11,350,210.55 | 2.12         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 515,216   | 9,423,300.64  | 1.76         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 727,948   | 8,502,432.64  | 1.59         |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 1,332,400 | 7,847,836.00  | 1.47         |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 109,695   | 7,239,870.00  | 1.35         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 240,189   | 6,679,656.09  | 1.25         |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 1,840,700 | 6,626,520.00  | 1.24         |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码     | 名称                       | 持仓量 | 合约市值(元)       | 公允价值变动(元)  | 风险说明                     |
|--------|--------------------------|-----|---------------|------------|--------------------------|
| IF1907 | 沪深 300 股指期货<br>IF1907 合约 | 11  | 12,556,500.00 | 60,060.00  | 买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理。 |
| IF1912 | 沪深 300 股                 | 3   | 3,402,720.00  | 185,460.00 | 买入股指期货                   |



|                   |                  |  |  |  |                    |
|-------------------|------------------|--|--|--|--------------------|
|                   | 指期货<br>IF1912 合约 |  |  |  | 合约的目的是进行更有效地流动性管理。 |
| 公允价值变动总额合计(元)     |                  |  |  |  | 245,520.00         |
| 股指期货投资本期收益(元)     |                  |  |  |  | 1,162,980.00       |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |                  |  |  |  | -1,190,220.00      |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，浦发银行系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,672,517.60 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,765.79     |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 1,677,283.39 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

## 十一、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

| 阶段                         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018年9月17日至<br>2018年12月31日 | -6.12% | 1.58%     | -5.71%     | 1.61%         | -0.41% | -0.03% |
| 2019年1月1日至<br>2019年6月30日   | 26.43% | 1.50%     | 25.50%     | 1.51%         | 0.93%  | -0.01% |

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

#### （四）基金财产的保管和处分

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

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

### 十三、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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### （三）估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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。

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

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；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、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债券，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。

6、本基金投资的股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、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。

8、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

双方协商解决。

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

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。

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。

#### （五）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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 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。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正。

### 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。

(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。

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券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，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。

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金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，由基金管理人就基金净值予以公布。

#### （八）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 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

### 十四、基金的收益与分配

#### （一）基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权。

2、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。

3、基金场内及场外份额的收益分配均采用现金方式。

4、在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。

5、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

#### （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、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （三）基金收益可分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数累计报酬率。

基金累计报酬率为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 100%；标的指数累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金累计报酬率超过标的指数累计报酬率的差额，当差额超过 1%时，基金可以进行收益分配。

期间如发生基金份额折算或拆分，则以基金份额折算或拆分日为初始日重新计算上述指标。

2、根据前述收益分配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，按法律法规的规定在指定媒介公告。

### （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。对于场外份额的收益分配，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，不足部分由基金管理人垫付。

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金运作费用

#### 1、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）标的指数许可使用费。

（4）基金上市费及年费。

（5）除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

（6）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。

（7）基金份额持有人大会费用。



（8）基金的证券交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等)。

（9）基金的银行汇划费用。

（10）基金收益分配中发生的费用。

（11）基金的登记结算费用。

（12）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。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不需召开持有人大会，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

## 2、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 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （3）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

指数许可使用费按当日基金管理费的 15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = F \times 15\%$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

F 为当日的基金管理费。

指数许可使用费的下限为前一日基金资产净值的 0.03%/当年天数，上限为前一日基金资产净值的 0.035%/当年天数。

标的指数许可使用费每日计算，按季支付。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。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。

（4）本条第（一）款第 1 项中第（4）至第（11）项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 3、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。

### （二）基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”中的“（六）申购和赎回的对价、费用及其用途”中的相关规定。

### （三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、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。

- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关会计制度。
- 5、本基金独立建账、独立核算。
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的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在 2 日内在指定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

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

### （二）信息披露义务人

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

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

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
- 2、对证券投资业绩进行预测。

- 3、违规承诺收益或者承担损失。
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构。
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字。
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

#### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

##### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（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。基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上。基金招募说明书的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书。

（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。

##### 2、基金产品资料概要

基金管理人根据《信息披露办法》的要求公告基金产品资料概要。基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站上和基金销售机构网站上或营业网点。基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金产品资料概要。

关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自中国证监会规定之日起开始执行。

##### 3、基金净值信息

基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营

业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### 4、基金份额申购赎回清单公告

在开始办理场内基金份额申购或者赎回之后，基金管理人将在每个开放日通过网站或其他媒介公告当日的申购赎回清单。

5、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

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。

#### 6、临时报告

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

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

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项。
- （2）基金终止上市交易、《基金合同》终止、基金清算。

- (3) 转换基金运作方式、基金合并。
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所。
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项。
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更。
- (7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人。
- (8) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动。
- (9) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十。
- (10) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。
- (11) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚。
- (12) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外。
- (13) 基金收益分配事项。
- (14) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更。
- (15) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五。
- (16) 本基金开始办理申购、赎回。
- (17) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请。
- (18) 变更标的指数。
- (19) 基金暂停上市、恢复上市。
- (20) 基金份额的折算及变更登记。
- (21) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项。
- (22) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 7、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

基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### 8、清算报告

基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### 10、中国证监会规定的其他信息。

基金将按照中国证监会的有关规定在定期报告等文件中披露股指期货、中小企业私募债券、国债期货等的投资情况。

#### （六）信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定以及证券交易所的自律管理规则。

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊，本基金只需选择一家报刊。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照《信息披露办法》等相关法律法规的规定和中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信

息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。（八）法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。

## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的主要风险

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 2、标的指数波动的风险

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

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

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

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

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

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具



造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### 4、标的指数变更的风险

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

#### 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管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。

#### 6、申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。

#### 7、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

中证指数有限公司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，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算还可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### 8、退市风险

因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。

#### 9、投资者申购失败的风险

基金管理人有权根据本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的场外或场内申购申请，从而导致申购失败。

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机构如发生交收违约，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。

#### 10、投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

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。

#### 11、场内基金份额赎回对价的变现风险

场内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。

#### 12、退补现金替代方式的风险

本基金在申购赎回环节新增了“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。

#### 13、基金场内外份额申购、赎回对价方式不同的风险

由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

#### 14、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。

#### 15、股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投

资股指期货主要存在以下风险：

- （1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- （2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- （3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。
- （4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- （5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。
- （6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

#### 16、第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

- （1）申购赎回代理机构因多种原因，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）登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，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交易所及其他代理机构。
- （3）证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### 17、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能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风险，例如，申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

根据证券交易资金前端风险控制相关业务规则，中登公司和交易所对交易参与人的证券交易资金进行前端额度控制，由于执行、调整、暂停该控制，或该控制出现异常等，可能影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。

#### 18、技术风险

在基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售代理机构等。

#### 19、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 20、流动性风险

在市场或个券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、以合理成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

##### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第七部分、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

##### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债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）。通常情况下，基金投资于跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%。一般情况下本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障持有人利益的基础上，防范流动性风险。

##### （3）场外巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生场外巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

- ①延期办理巨额赎回申请；
- ②暂停接受赎回申请；
- ③延缓支付赎回款项；
- ④中国证监会认定的其他措施。

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

由于本基金存在场外份额，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，对场

外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的辅助措施，包括但不限于：

①延期办理场外巨额赎回申请

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

在此情形下，投资者的全部或部分场外赎回申请可能将被延期办理，同时投资人完成基金场外赎回时的基金份额净值可能与其提交场外赎回申请时的基金份额净值不同。

②暂停接受场外赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第七部分、基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、场外巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金暂停接受场外赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部场外赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金场外赎回时的基金份额净值可能与其提交场外赎回申请时的基金份额净值不同。

③延缓支付场外赎回款项

投资人具体请参见基金合同“第七部分、基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、场外巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

④暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十五部分、基金资产估值”中的“六、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时场外赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付场外赎回款项。

⑤中国证监会认定的其他措施。

## 21、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

## （二）声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售代理机构销售，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。

3、本基金并非由 MSCI INC.（“MSCI”）、其任何关联机构、其任何信息提供方或参与或涉及收集、计算或创建任何 MSCI 指数的任何其他第三方（统称“MSCI 各方”）保荐、担保、销售或推介。MSCI 指数是 MSCI 的专有财产。MSCI 名称和 MSCI 指数名称均是 MSCI 或其关联机构的服务标识，并已经许可给[被许可方]为特定目的使用。MSCI 各方均未就一般的基金投资或特别针对投资本基金的行为是否明智或者任何 MSCI 指数跟踪相应股票市场表现的能力向本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体作出任何明示或默示的陈述或保证。MSCI 或其关联机构是若干商标、服务标记和高号的许可方，也是由 MSCI 在未考虑本基金或本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体的情况下确定、编制和计算的 MSCI 指数的许可方。在确定、编制和计算 MSCI 指数时，MSCI 各方均无义务考虑本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体的需要。MSCI 各方均不负责也未参与确定本基金的发行时间、发行价格或数量，或本基金赎回公式或赎回对价的确定或计算。而且，MSCI 各方均不就本基金的管理、营销或发售向本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体承担任何义务或责任。

尽管 MSCI 应自其认为可靠的来源获取 MSCI 指数中包含的或用来计算 MSCI 指数的信息，MSCI 各方均不保证或担保任何 MSCI 指数或其中包含的任何数据的独创性、准确性及/或完整性。MSCI 各方未就本基金的发行人、本基金的所有人或任何其他个人或实体使用 MSCI 指数或其中包含的任何数据时将会获得的结果作出任何明示或默示的担保。MSCI 各方均不会就 MSCI 指数或其中包含的任何数据的任何差错、遗漏或中断或与 MSCI 指数或其中包含的任何数据有关的任何差错、遗漏或中断承担任何责任。此外，MSCI 各方均未作出任何类型的明示或默示的保证，并且 MSCI 各方特此明确表示不对每一 MSCI 指数及其中包含的任何数据作出任何适销性和对特定用途的适用性的任何保证。不限制前述任何规定，即使已被告知发生以下损害赔偿的可能性，在任何情况下 MSCI 各方均不就任何直接的、间接的、特别的、惩罚性、推定性或任何其他损害赔偿（包括利润损失）承担任何责任。

## 十九、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表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

## （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

## 二十、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

### 第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 一、基金管理人

##### （一）基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

设立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

存续期限：100 年

联系电话：400-818-6666

##### （二）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集基金。



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

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

(4) 销售基金份额。

(5) 召集基金份额持有人大会。

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人。

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理。

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

(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、融券和转融通等业务。

(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、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构。

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则。

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

(2) 办理基金备案手续。

- (3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产。
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资。
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产。
- (7) 依法接受基金托管人的监督。
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的对价。
- (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、中期和年度基金报告。
- (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：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权呈报中国证监会，并可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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(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》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，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价。

(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、中期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) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对。

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

（14）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份额持有人依法召集基金份额持有人大会。

（15）按照法律法规和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作。

（16）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。

（17）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。

（18）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。

（19）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。

（20）执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（21）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》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益。

（2）参与分配清算后的剩余基金财产。

（3）依法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》。
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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) 缴纳应付基金认购、申购、赎回对价及法律法规和《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定。
- (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。

## 第二部分 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。基金份额持有人大会不设立日常机构。

### 一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (2) 更换基金管理人。
- (3) 更换基金托管人。
- (4) 转换基金运作方式（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。
- (6) 变更基金类别。
- (7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (9) 变更基金份额持有人大会程序（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会。

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

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

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

2、在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取。

(2) 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、赎回费率或收费方式。

(3) 增加、减少、调整基金份额类别设置。

(4) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成。

(5) 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。

(6) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回。

(7) 基金管理人、证券交易所、登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则。

(8) 基金推出新业务或服务。

(9) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改。

(10) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化。

(11) 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。

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

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 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。

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计



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

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会或通讯开会等方式召开，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 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名

基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 5 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 七、计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## 八、生效与公告

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

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后 2 日内按照法律法规和中国证监会相关规定的要求在指定媒介上公告。

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、关于本基金的联接基金所持本基金份额行使表决权的方式

如果本基金推出联接基金，鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的持有人可以凭所持有的联接基金份额行使与本基金相关的持有人权利，如本基金基金份额持有人大会召集权、直接参加本基金基金份额持有人大会的表决权。计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人的参会份额数和票数按权益登记日联接基金所持有的本基金的基金份额、该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例折算。

十、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 第三部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

## 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

## 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

### 第四部分 争议解决方式

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 第五部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《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。

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

### 一、托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区

法定代表人：杨明辉

成立时间：1998年4月9日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38亿元人民币

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

存续期间：100年

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库、标的指数成份股和备选成份股库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督：

- （1）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%。
- （2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%。
- （3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%。
- （4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%。
- （5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%。
- （6）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%。
- （7）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。
- （8）基金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。
- （9）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期。
- （10）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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）应符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。



（11）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

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

（13）本基金总资产不得超过基金净资产的140%。

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

（15）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。

（16）法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除第（7）、（14）、（15）项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，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。期间，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本基金合同生效之日起开始。

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。

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

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及本协议的约定，应及时提示基金管理人限期纠正，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管

人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规或本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规或本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，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。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

（一）在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

### 四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金和股票划入在本基金的银行账户和证券账户。

（三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

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

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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人和基金托管人以基金名义在相关法规规定范围内的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。若基金托管人认为存款银行存在风险，可与基金管理人协商解决。若无法达成一致意见，可向监管部门报告。

（五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

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

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

#### （六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；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开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

### 五、基金资产净值的计算和复核

#### （一）基金资产净值的计算和复核

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

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

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

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

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

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

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

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

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册。
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册。

3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册。

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

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

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

## 七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## 二十二、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、申购赎回代理机构提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

（一）呼叫中心

1、自动语音服务

提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新热点问题、基金份额净值等信息。

2、人工电话服务

提供每周 7 天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为 8：30~21：00，周六至周日的人工电话服务时间为 8：30~17：00，法定节假日除外。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

## （二）在线服务

投资者可通过本公司网站、APP、微信公众号、微官网等渠道获得在线服务。

### 1、自助服务

在线客服提供每周7天、每天24小时的自助服务，投资者可通过在线客服查询最新热点问题、业务规则、基金份额净值等信息。

### 2、人工服务

周一至周五的在线客服人工服务时间为8：30~21：00，周六至周日的在线客服人工服务时间为8：30~17：00，法定节假日除外。

### 3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)

电子信箱：[service@ChinaAMC.com](mailto:service@ChinaAMC.com)

## （三）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过申购赎回代理机构的服务电话对该申购赎回代理机构提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十三、其他应披露事项

（一）2019年11月28日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复。
- 2、《华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年十二月四日