

# 国金基金管理有限公司

## 国金上证 50 指数增强证券投资基金

(LOF)

### 招募说明书

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

二〇二一年三月

## 国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）招募说明书

### 重要提示

1、国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）由国金上证 50 指数分级证券投资基金经中国证监会 2019 年 1 月 22 日证监许可〔2019〕118 号文批准变更注册而来。

2、本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会准予国金上证 50 指数分级证券投资基金的变更注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

3、本基金标的指数为：标普中国 A 股低波红利指数。

#### （1）指数样本空间

上证 50 指数以上证 180 样本为样本空间，挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的 50 只证券作为样本，综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体表现。

#### （2）指数选样方法

对样本空间内的证券按照过去一年的日均总市值、日均成交金额进行综合排名，选取排名前 50 位的证券组成样本。

#### （3）指数加权方式

调整市值加权。

#### （4）指数样本股权重调整

##### 1) 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过 10%，定期调整设置缓冲区，排名在 40 名之前的新样本优先进入，排名在 60 名之前的老样本优先保留。

##### 2) 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时,将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理,参照计算与维护细则处理。对新发行证券的发行总市值(总市值=发行价×总股本)和沪市证券自该新发行证券上市公告日起过去一年的日均总市值进行比较,对于符合样本空间条件、且发行总市值排名在沪市市场前 10 位的新发行证券,启用快速进入指数规则,即在其上市第十个交易日结束后将其纳入指数,同时剔除原样本中过去一年日均总市值、成交金额综合排名最末的证券,科创板上市证券不适用该规则。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见:中证指数有限公司网站(具体网址为:<http://www.sse.com.cn/market/sseindex/indexlist/>)

4、本基金为股票指数增强型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

5、跟踪标的指数的风险主要包括:(1)标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、(2)标的指数波动的风险、(3)基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、(4)标的指数变更的风险、(5)指数编制方案变更风险、(6)标的指数成份股停牌的风险、(7)跟踪误差控制未达约定目标的风险、(8)指数编制机构停止服务的风险、(9)标的指数值计算出错的风险、(10)主动增强投资的风险、(11)上市交易风险。

6、投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:基金特定的投资品种相关的特定风险,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的市场风险,因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,因投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险,基金投资过程中产生的运作风险以及不可抗力风险等。其中,基金特定的投资品种相关的特定风险指投资中小企业私募债等非公开发行的债券品种因信息披露不充分而可能发生的流动性风险、信用风险等。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

7、基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金

的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

8、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

9、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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

10、基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况导致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2021 年 3 月 29 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2020 年 6 月 30 日。

## 目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	8
四、基金托管人.....	17
五、相关服务机构.....	22
六、基金的历史沿革.....	22
七、基金的存续.....	44
八、基金份额的上市交易.....	45
九、基金份额的申购与赎回.....	46
十、基金的投资.....	58
十一、基金的业绩.....	72
十二、基金的财产.....	74
十三、基金资产估值.....	75
十四、基金的收益与分配.....	81
十四、基金费用与税收.....	83
十五、基金的会计与审计.....	86
十六、基金的信息披露.....	87
十七、风险揭示.....	94
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	103
十九、基金合同内容摘要.....	105
二十、基金托管协议的内容摘要.....	122
二十一、对基金份额持有人的服务.....	136
二十二、其他应披露事项.....	138
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	140
二十四、备查文件.....	141

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）等有关法律法规以及《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。

本基金是由国金上证 50 指数分级证券投资基金变更注册而来，本招募说明书由国金基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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。基金投资人欲了解本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

在基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF），本基金由国金上证 50 指数分级证券投资基金变更注册而来

2、基金管理人：指国金基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国民生银行股份有限公司

4、基金合同：指《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充，基金合同由《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新

7、上市交易公告书：指《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）上市交易公告书》

8、基金产品资料概要：指《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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

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

22、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

23、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

24、基金销售业务：指基金管理人或其他销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其



他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

26、基金销售网点：指直销机构的直销中心及其他销售机构的销售网点

27、会员单位：指具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

28、场外：指通过上海证券交易所外的销售机构办理基金份额申购、赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

29、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

30、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或上海证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

31、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

32、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

33、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统

34、场外份额：指登记在登记结算系统下的基金份额

35、场内份额：指登记在证券登记系统下的基金份额

36、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，基金投资者办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户

37、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

38、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户，基金投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户

39、基金合同生效日：指《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止

40、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

41、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

42、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

43、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

44、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

45、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

46、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

47、《业务规则》：指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人、基金销售机构的相关业务规则

48、标的指数：指上证 50 指数

49、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

50、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

51、上市交易：指基金合同生效后，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

52、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

53、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所

持基金份额销售机构的操作

54、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为

55、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转托管的行为

56、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

57、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

58、元：指人民币元

59、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

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

61、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

62、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

63、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

64、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

65、摆动定价机制：指当本基金份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

66、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

67、不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法避免且无法克服的客观事件或因素

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：国金基金管理有限公司

成立日期：2011 年 11 月 2 日

住所：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

法定代表人：尹庆军

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-88005812

注册资本：3.6 亿元人民币

股权结构：

国金基金管理有限公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，四家企业共同出资 3.6 亿元人民币，出资比例分别为 49%、19.5%、19.5% 和 12%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

纪路先生，董事长，硕士 EMBA。历任博时基金管理有限公司研究员、金信证券有限责任公司投资研究中心总经理、国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司副总经理，国金基金管理有限公司董事长，国金证券（香港）有限公司董事，国金财务（香港）有限公司董事，国金证券上海投资咨询分公司总经理，上海国金理益财富基金销售有限公司执行董事。

金鹏先生，董事，研究生学历。历任涌金期货经纪有限公司总经理助理，上海涌金理财顾问有限公司副总经理，河北财金投资有限公司总经理，涌金实业（集团）有限公司副总裁，国金证券有限责任公司风险控制中心总经理，国金证券股份有限公司董事、副总经理、监事、监事会主席，国金期货有限责任公司董事长。现任国金证券股份有限公司董事、总经理，国金创新投资有限公司董事长，国金期货有限责任公司董事，国金基金管理有限公司董事，国金证券（香港）有限公司董事，国金金融控股（香港）有限公司董事。

黄艳女士，董事，硕士，高级经济师。历任华夏银行苏州支行国际业务部职员，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部职员，苏州工业园区地产经营管理公司综合部副总经理、总经理，苏州工业园区地产经营管理公司总裁助理、副总裁。现任苏州工业园区经济发展有限公司副总裁，国金基金管理有限公司董事。

宁远喜先生，董事，硕士。历任三九集团工程有限公司办公室主任，深圳伯龙建筑工程有限公司总经理助理，广东宝丽华集团有限公司广告部经理，广东宝丽华实业股份有限公司董事会秘书。现任广东宝丽华新能源股份有限公司董事长，广东宝新资产管理有限公司执行董事，宝新融资租赁有限公司执行董事，广东信用宝征信管理有限公司执行董事，梅州客商银行股份有限公司董事长，百合佳缘网络集团股份有限公司副董事长，国金基金管理有限公司董事，深圳微金所金融信息服务有限公司董事，宝合金服投资管理股份有限公司董事。

赵煜先生，董事，学士。历任北京台都汽车安全设备有限公司销售经理，北京顶峰贸易公司销售经理，上海浦东中软科技发展有限公司副总经理。现任涌金实业（集团）有限公司董事长助理，国金基金管理有限公司董事。

尹庆军先生，董事，硕士。历任中央编译局世界所助理研究员、办公厅科研外事秘书，中央编译出版社出版部主任，博时基金管理有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、监事，国金基金管理有限公司（筹）拟任督察长，国金基金管理有限公司督察长。现任国金基金管理有限公司董事、总经理，北京千石创富资本管理有限公司董事长。

张克东先生，独立董事，学士，注册会计师。历任煤炭工业部技术发展司、煤炭科学研究总院科员、主任科员，中国国际经济咨询公司、中信会计师事务所咨询员、项目经理，中信会计师事务所副主任，中天信会计师事务所副主任。现任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人，国金基金管理有限公司独立董事。

鲍卉芳女士，独立董事，硕士。历任湖北省郟阳地区法律顾问处律师，最高人民检察院法纪厅书记员，北京市中银律师事务所律师，北京市博宇律师事务所律师，北京市大成律师事务所律师，北京市同维律师事务所律师。现任北京市康达律师事务所合伙人、律师，国金基金管理有限公司独立董事。

张勇先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任中国建设银行北京分行二处副处长，中国建设银行北京信托公司总经理，中国信达资产管理股份有限公司托

管清算部总经理，中国金谷国际信托有限责任公司董事长。现任国金基金管理有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

刘泮先生，监事会主席，硕士。历任南方报业传媒集团资深记者，广东宝丽华新能源股份有限公司董事会秘书、董事。现任广东宝丽华新能源股份有限公司副董事长、总经理兼董事会秘书，国金基金管理有限公司监事会主席、股东代表监事。

许强先生，监事，硕士。历任苏州商品交易所交易部、交割部、信息部总经理，中国华通物产集团经易期货经纪有限公司副总裁，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部总经理，苏州工业园区地产经营管理公司投资部总经理。现任苏州工业园区资产管理有限公司董事长、国金基金管理有限公司股东代表监事。

刘容女士，职工代表监事，硕士。历任北大方正物产集团农产品部期货研究员兼总办会助理，国金基金管理有限公司（筹）风险管理部风险分析师，国金基金管理有限公司风险管理部风险分析师兼董事会秘书、合规风控部总经理助理、合规风控部副总经理。现任国金基金管理有限公司合规风控部总经理、职工代表监事，北京千石创富资本管理有限公司股东代表监事。

于晓莲女士，职工代表监事，学士。历任中国建设银行投资托管服务部基金会计，国金基金管理有限公司（筹）清算部基金会计，国金基金管理有限公司基金清算部副总经理。现任国金基金管理有限公司运营支持部副总经理、职工代表监事。

## 3、总经理及其他高级管理人员

纪路先生，董事长，硕士 EMBA。简历请见上文。

尹庆军先生，总经理，硕士。简历请见上文。

张丽女士，督察长，硕士，通过国家司法考试，国际注册内部审计师。历任科学出版社法律事务部内部法律顾问，国金基金管理有限公司（筹）监察稽核部法律顾问，国金基金管理有限公司监察稽核部法律顾问、监察稽核部副总经理兼法律顾问、监察稽核部总经理。现任国金基金管理有限公司督察长。

聂武鹏先生，副总经理，首席信息官，硕士。历任天虹商场股份有限公司培训专员，TCL 集团股份有限公司招聘及培训经理，深圳迅雷网络技术有限公司

高级招聘经理、国金基金管理有限公司（筹）综合管理部总经理助理兼人力资本经理，国金基金管理有限公司总经理助理、运营总监兼运营支持部总经理、职工代表监事。现任国金基金管理有限公司副总经理、首席信息官兼运营总监，北京千石创富资本管理有限公司监事会主席。

陈琨先生，副总经理，硕士。历任平安证券南京营业部营销部、银证通部营销总监，平安集团渠道发展事业部团队主管，中海基金管理有限公司机构业务部高级经理、渠道业务部副总监、营销中心副总经理、总经理室总经理助理，南华基金管理有限公司副总经理。现任国金基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

林霄先生，副总经理，学士。历任新浪网技术（中国）有限公司华北销售部高级客户经理、编辑，阳光保险集团股份有限公司电子商务部市场总监，安邦保险集团股份有限公司电子商务部运营总监，国金基金管理有限公司市场营销部总经理、互联网金融中心总经理、总经理助理兼网金总监。现任国金基金管理有限公司副总经理兼网金总监。

于涛先生，副总经理，博士。历任中国农业银行山东省分行公司信贷部高级经理，大公国际评估有限公司工商企业评级部总经理，中债资信评估有限公司研究部副总经理，银河基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员，融通基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员、信用债研究主管，安信证券股份有限公司资产管理部高级债券投资经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级债券基金经理，富荣基金管理有限公司副总经理，国金基金管理有限公司总经理助理兼固定收益投资总监。现任国金基金管理有限公司副总经理兼固定收益投资总监。

#### 4、基金经理

宫雪女士，博士。历任博时基金管理有限公司股票投资部产业分析师，国金基金管理有限公司产品经理、行业分析师、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业部总经理兼产品中心代总经理。现任国金基金管理有限公司创新投资部总经理。截至本招募说明书更新公布之日，宫雪女士兼任国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金标普中国 A 股低波红利指数增强证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化添利定期开放



债券型发起式证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理尹庆军先生，副总经理兼固定收益投资总监于涛先生，交易总监兼基金交易部总经理詹毛毛先生，研究部固收研究总监尹海峰先生，创新投资部总经理兼基金经理宫雪女士，量化投资事业部总经理兼投资经理姚加红先生，固定收益投资部总经理兼基金经理徐艳芳女士，主动权益投资总监兼主动权益投资部总经理张航先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

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

2、办理本基金备案手续。

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、编制定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

8、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。

9、按照规定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、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

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

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

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资。
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金资产。
- (3) 承销证券。
- (4) 将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款。
- (5) 从事承担无限责任的投资。
- (6) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- (7) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

(8) 侵占、挪用基金财产。

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

- (10) 玩忽职守，不按照规定履行职责。
- (11) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营。
- (2) 违反基金合同或托管协议。
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益。
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露。
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管。

(6) 玩忽职守、滥用职权。

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

(8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资。

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场

价格，扰乱市场秩序。

- (11) 贬损同行，以提高自己。
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。
- (13) 以不正当手段谋求业务发展。
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象。
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 5、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益。

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

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

(2) 独立性原则：设立独立的合规风控部，合规风控部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

(3) 相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

### 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

- (1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终

的责任。

(2) 督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

(3) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

(4) 风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控。

(5) 合规风控部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标，并负责对投资事前及事中的风险监控，具体落实针对投研运作的相关法律法规、公司制度及日常的投研风控决策，设置相应的投研风控措施，并对各投资组合风险进行分析，对发现的异常及时向相关部门反馈，以作为调整投资决策的依据。

(6) 业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责人对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、内部控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有

关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行成立于 1996 年，是中国第一家主要由民营企业发起设立的全国性股份制商业银行，也是严格按照中国《公司法》和《商业银行法》设立的一家现代金融企业。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（代码：600016）在上海证券交易所挂牌上市。2005 年 10 月 26 日，中国民生银行完成股权分置改革，成为国内首家实施股权分置改革的商业银行。2009 年 11 月 26 日，中国民生银行 H 股股票（代码：01988）在香港证券交易所挂牌上市。上市以来，中国民生银行不断完善公司治理，大力推进改革转型，持续创新商业模式和产品服务，致力于成为一家“让人信赖、受人尊敬”的上市公司。

#### 2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有 26 年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

#### 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 74 人,平均年龄 39 岁,100%员工拥有大学本科以上学历,63%以上员工具有硕士学位。

中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念,依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌,近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心,致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源,对外广泛搭建客户服务平台,向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务,得到各界的充分认可,也在市场上树立了良好品牌形象,成为市场上一家有特色的托管银行。自 2010 年至今,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖,荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖,尤其继 2019 年被《金融时报》评为年度唯一“最佳资产托管银行”之后,在 2020 年度再次被评为唯一“最具资产托管创新力银行”。

截至 2020 年 12 月 31 日,中国民生银行托管建信稳定得利债券型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金等共 282 只证券投资基金,基金托管规模 7707.67 亿元。

## (二)基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系,形成科学的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念,严格控制合规风险,保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规

则。

(3)以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障,以完善健全的制度为基础,以落实到位的过程控制为着眼点,以先进的信息技术手段为依托,建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

## 2. 内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会,对高级管理层负责,支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

总行各部门紧密配合,共同把控资产托管业务运行中的风险,具体职责与分工如下:总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构,是全行风险管理的统筹部门,对资产托管部的风险控制工作进行指导;总行法律合规部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等法律性文件的审定,对业务开展进行合规检查并督导问题整改落实;总行审计部对全行托管业务进行内部审计,包括定期内部审计、现场和非现场检查等;总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应急预案。

## 3. 内部风险控制原则

(1)合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2)全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员,并涵盖资产托管业务各环节。

(3)有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行,任何人都没有超越制度约束的权力。

(4)预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念,控制资产托管业务中风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5)及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题,要及时处理,堵塞漏洞。

(6)独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险与合规



管理中心是资产托管部下设的执行机构,不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开,以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7)相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确,相互牵制,通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8)防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

#### 4. 内部风险控制制度和措施

(1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估:定期组织进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

(6)应急预案:制定完备的应急预案,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

#### 5. 资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题新情况不断出现,我们始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。我们通过建立纵向双人

制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。我们十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度落实检查是风险控制管理的有力保证。资产托管部内部设置风险与合规管理中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行检查。总行审计部不定期对托管业务进行审计。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

### (三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、基金托管协议和有关法律法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投资比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等进行监督和核查。

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构

##### 1) 国金基金管理有限公司直销中心

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

联系人：肖娜

联系电话：010-88005819

客服信箱：service@gfund.com

客服电话：4000-2000-18

传真：010-88005816

网站：[www.gfund.com](http://www.gfund.com)

##### 2) 国金基金移动客户端

移动客户端（APP）名称：及第理财

目前支持的移动客户端支付渠道：通联支付

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：service@gfund.com

##### （2）其他销售机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构

##### 1) 国金基金管理有限公司直销中心

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

联系人：石迎春

联系电话：010-88005812

客服信箱：service@gfund.com

客服电话：4000-2000-18

传真：010-88005816

网站：[www.gfund.com](http://www.gfund.com)

2) 国金基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://trade.gfund.com>

目前支持的网上直销支付渠道：建行卡、工行卡、天天盈、通联支付

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：[service@gfund.com](mailto:service@gfund.com)

3) 国金基金移动客户端

移动客户端 (APP) 名称：及第理财

目前支持的移动客户端支付渠道：通联支付

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：[service@gfund.com](mailto:service@gfund.com)

## (2) 其他销售机构

1) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：陈鹤

电话：010-57092851

传真：010-57092611

客服电话：95568

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

2) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁东路 345 号

邮政编码：315000

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：0574-89068340

客服电话：95574

网址：www.nccb.com.cn

3) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：杜晶

电话：028-86690057

传真号码：028-86690126

客服电话：95310

网址：www.gjq.com.cn

4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：黄博铭

网址：www.gtja.com

服务热线：95521 / 4008888666

5) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号 B 座 18 层

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

网址：www.csc108.com

6) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

客服电话：95565，4008-888-111

网址：www.newone.com.cn

7) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

8) 申万宏源证券有限公司

注册地址：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（邮编：200031）

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

9) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：许建平

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

10) 安信证券股份有限公司

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

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，深

圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

网址：<http://www.essence.com.cn/>

11) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

客服电话：95548

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

12) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531；400-8888-588

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

13) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层

办公地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层

法定代表人：严亦斌

客服电话：95564

网址：<http://www.ykzq.com>

14) 华金证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

邮政编码：200127

法定代表人：宋卫东

联系人：秦臻

电话：021-20655593

传真：021-20655577

客服电话：4008211357

网址：[www.huajinsc.cn](http://www.huajinsc.cn)

15) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

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：翁振杰

联系人：黄静

电话：010-84183333

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

客户服务电话：400-818-8118

16) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

邮政编码：518028

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

电话：010-86499427

传真：010-86499401

客服电话：400-620-6868

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

17) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

客服电话：956088, 4001966188

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



## 18) 东北证券股份有限公司

注册地址：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

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

## 19) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

网址：<http://www.gzs.com.cn/>

客服电话：95396

## 20) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行  
营业大楼

法定代表人：徐丽峰

客服电话：956080

网址：www.gszq.com

## 21) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

客服电话：95582

网址：<http://www.west95582.com/>

## 22) 中信建投期货有限公司

注册地址：重庆渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：彭文德

客服电话：400-8877-780 023-63600049

网址：www.cfc108.com

## 23) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：021-60819988

邮箱：liuhongying@citicsf.com

公司网站：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

公司邮编：518048

## 24) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

## 25) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com/>

## 26) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号 1501-1502 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号 1501-1502 室

法定代表人：陈洪生

客服电话： 400-6533-789

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

27) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址： 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址： 上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人： 汪静波

客服电话： 4008-215-399

网址： [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

28) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址： 深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层  
12-13 室

办公地址： 深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层  
12-13 室

法定代表人： 薛峰

客服电话： 4006-788-887

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

29) 上海天天基金销售有限公司

注册地址： 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址： 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人： 其实

联系人： 屠彦洋

电话： 95021

客服电话： 400-1818-188

网址： [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

30) 上海好买基金销售有限公司

注册地址： 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址： 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人： 杨文斌

客服电话： 400-700-9665

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

31) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座

法人代表：祖国明

客户服务电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

32) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

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

33) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺新大楼

法定代表人：吴强

客服电话：952555

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

34) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3205

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

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

35) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：宝山区蕴川路 5475 号 1033 室查看地址

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融市场 53 层

法定代表人：李兴春

客服电话： 95733

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

36) 嘉实财富管理有限公司

注册地址： 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层  
4609-10 单元

邮政编码： 200120

法定代表人： 赵学军

客服电话： 400-021-8850

网址： [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

37) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址： 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址： 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人： 王锋

客服电话： 95177

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

38) 浦领基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

办公地址： 北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层

法定代表人： 聂婉君

联系人： 李艳

电话： 010-59497361

客服电话： 400-012-5899

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

39) 北京增财基金销售有限公司

注册地址： 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址： 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人： 罗细安

联系人： 钟苓玉

电话： 010-67000988

客服电话：010-67000988-6025

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

40) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 楼

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

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

41) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 19 层 19C13

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

42) 深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1

邮政编码：518000

法定代表人：苗宏升

联系人：王清臣

电话：0411-6688-9822

客服电话：4007-903-688

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

43) 一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

客户服务电话：400-001-1566

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

44) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

45) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：王军辉

客服电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

46) 公司名称：海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：巩巧丽

客服电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

47) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-124 室

邮政编码：100016

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287984

客服电话：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

48) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

客服电话：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

49) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

客服电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

50) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

邮政编码：310000

法定代表人：陈刚

联系人：张丽琼

电话：0571-86655920

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86655920

网址：www.cd121.com

51) 北京辉腾汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号 2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B

法定代表人：许宁

客服电话：400-829-1218

网址：www.htfund.com

52) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎



客服电话：400-799-1888

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

53) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-118-1188

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

54) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号 C5 幢 1 楼

法定代表人：金佶

客服电话：021-34013999

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

55) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：<https://www.jiyufund.com.cn>

56) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

邮政编码：200002

法定代表人：陈继武

客服电话：4006-433-389

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

57) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A

单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A

单元

法定代表人：祝中村

联系人：曾瑶敏

电话号码：0755-83999907

传真号码：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

公司网址：[www.fujifund.cn](http://www.fujifund.cn)

58) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区台北一路 17-79 号环亚大厦 B 座 601 室

办公地址：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

法定代表人：陶捷

客服电话：400-027-9899

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

59) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客服电话：400-821-9031

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

60) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

61) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5

楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5

楼 503

法定代表人：王旋

联系人：罗聪

电话：0371-55213196

传真：0371-85518397

客服电话：4000555671

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

62) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：400-684-0500

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

63) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：400-890-9998

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

64) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

电话：95118

传真：010-89189566

客服电话：95118

网址：<http://kenterui.jd.com/>

65) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

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

66) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

邮政编码：200127

法定代表人：戴新装

联系人：朱学勇

电话：021-20538888

传真：021-20538999

客服电话：400-820-1515

网址：<http://www.zhengtongfunds.com>

67) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区融新科技中心 C 座 17 层蛋卷基金

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

电话：010-61840688

客服电话：4001599288

网址：<https://www.danjuanapp.com>

68) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓  
2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：张军

联系人：王芳芳

电话：010-59013842

传真：010-59013707

客服电话：010-59013895

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

69) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座  
13、14 层

法定代表人：路昊

联系人：张爽爽

电话：021-68595976

传真：021-68595766

客服电话：952303

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

70) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：张竞妍

电话：025-66046166

传真：025-56878016

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

客户服务电话：025-66046166

71) 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

联系人：孙博超

电话：010- 61952703

传真：010- 61951007

客服电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

72) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

邮政编码：200080

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

电话：010-88066326

传真：010-63136184

客服电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

73) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谱

客服电话：400-080-8208

网址：www.100bbx.com

74) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址：广州市天河区珠江西路 15 号珠江城大厦 42 层

法定代表人：于海锋

网址：<http://www.puyifund.com/>

客服电话：400-080-3388

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

## 2、场内发售机构

本基金的场内发售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位。

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：（010）50938856

传真：（010）50938991

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

法定代表人：毛鞍宁

经办注册会计师：王珊珊、王海彦

联系电话：010-58152145

传真：010-85188298

联系人：张晖

## 六、基金的历史沿革

国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）由国金上证 50 指数分级证券投资基金变更注册而来。

国金上证 50 指数分级证券投资基金经 2015 年 4 月 10 日中国证监会证监许可【2015】594 号文准予注册，基金管理人为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 27 日生效。

国金上证 50 指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 2019 年 8 月 27 日表决通过了《关于国金上证 50 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意国金上证 50 指数分级证券投资基金由指数分级基金转为指数增强基金（LOF），基金名称相应变更为“国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）”，国金上证 50 指数分级证券投资基金之国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额及国金上证 50B 份额均折算为国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）份额。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2019 年 10 月 14 日正式实施基金转型，自基金转型实施日起，《国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同》失效且《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，国金上证 50 指数分级证券投资基金正式变更为国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）。



## 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，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的上市交易

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请本基金上市交易。基金上市后，登记在证券登记系统中的基金份额可直接在上海证券交易所上市交易；登记在登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记系统中，再上市交易。

### 一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为上海证券交易所。

### 二、上市交易的时间

基金合同生效后，基金管理人可根据有关规定，在符合基金上市交易条件下，申请本基金在上海证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。

### 三、上市交易的规则

本基金在上海证券交易所的上市交易需遵循《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规则》、《上海证券交易所上市开放式基金业务指引》等有关规定。

### 四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定执行。

### 五、上市交易的停复牌和终止上市

本基金的停复牌和终止上市按照相关法律法规、中国证监会和上海证券交易所的相关规定执行。

六、若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

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

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销机构及基金场外其他销售机构，场内申购和赎回场所为上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体的销售机构将由基金管理人在本招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所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。

若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告本基金办理申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“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；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、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；

5、投资者通过上海证券交易所办理本基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，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、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。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

#### （五）申购和赎回的数额限制

1、投资人通过基金管理人直销中心办理本基金的场外申购时，首次单笔申购最低限额为10000元（含申购费，下同），追加单笔申购最低限额为1000元。

投资人通过基金管理人网上直销系统办理本基金的场外申购时,首次单笔申购最低限额为1元,追加单笔申购最低限额为1元。投资者通过其他销售机构办理本基金的场外申购时,具体的最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构网点公告。投资人当期分配的基金收益转购基金份额时,不受最低申购金额的限制。

2、投资者通过场内销售机构办理申购时,单笔申购最低金额为1000.00元,同时申购金额必须是整数金额。单笔申购最高金额不超过9,999,999,999.00元。

3、基金份额持有人通过场外销售机构赎回基金份额的单笔赎回申请不得低于1份基金份额;基金份额持有人赎回时或赎回后在某一场外销售机构(网点)单个交易账户保留的基金份额余额不足1份的,余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回,若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于1份时,基金管理人有权对剩余部分进行强制赎回。

4、基金份额持有人通过场内销售机构赎回基金份额的单笔赎回申请不得低于1份基金份额,且通过场内单笔申请赎回的基金份额必须是整数份,且单笔赎回最高不超过99,999,999.00份基金份额。

5、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制。未来,基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制,具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。

6、基金管理人可以对基金的总规模进行限制,具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。

7、基金管理人可以规定单个投资人单日申购金额上限,具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告。

8、基金管理人可以规定本基金单日的申购金额上限,具体规定请参见定期更新的招募说明书或相关公告。

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

10、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等,上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的,从其最新规定办理。

11、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （六）申购费用和赎回费用

##### 1、申购费率

###### （1）场外申购费用

本基金场外基金份额申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.00%
M ≥ 200 万元	按笔收取，1000 元/笔

本基金的申购费用由申购份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

###### （2）场内申购费用

本基金场内基金份额申购费率参照场外申购费率执行。

##### 2、赎回费率

###### （1）场外赎回费

本基金场外基金份额的赎回费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y < 7 天	1.50%
7 天 ≤ Y < 180 天	0.50%
180 天 ≤ Y < 365 天	0.25%
Y ≥ 365 天	0.00%

注：①Y 为基金份额持有期限

②本基金转型前国金上证 50 指数分级证券投资基金基金份额持有人的基金份额持有期限将计入其持有本基金基金份额的持有期限。

###### （2）场内赎回费用

本基金的场内基金份额赎回费率参照场外赎回费率执行。

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由基金份额投资人承担,对持续持有期低于 7 天的投资人,赎回费全额计入基金财产,对持续持有期高于 7 天(含 7 天)的投资人,不低于赎回费总额的 25%应归基金财产。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、办理场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

#### (七) 申购份额与赎回金额的计算

##### 1、申购份额的计算

本基金场外申购和场内申购均采用金额申购的方式,申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为:

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

$$(\text{对于适用固定金额申购费的申购, 申购费用} = \text{固定申购费金额})$$

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

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

场外申购份额计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。场内申购份额计算结果首先按四舍五入的原则保留到小数点后两位,再采用截位法保留到整数位,整数位后小数部分的份

额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资者投资 10 万元通过场外申购本基金，对应费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 100,000 \times 1.20\% / (1 + 1.20\%) = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 1185.77 = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.0150 = 97,353.92 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元通过场外申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元，则可得到 97,353.92 份基金份额。

例：某投资者投资 10 万元通过场内申购本基金，对应费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 100,000 \times 1.20\% / (1 + 1.20\%) = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 1185.77 = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.0150 = 97,353.92 \text{ 份 (四舍五入保留到小数点后两位)} \\ = 97,353.00 \text{ 份 (保留至整数位)}$$

$$\text{实际净申购金额} = 97,353.00 \times 1.0150 = 98,813.30 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,813.30 - 1185.77 = 0.93 \text{ 元}$$

即投资者投资 10 万元通过场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元，则申购费用为 1185.77 元，投资者可得到 97,353 份基金份额，并得到退款金额 0.93 元。

## 2、赎回金额的计算

本基金场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式，赎回金额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后 2 位。赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

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

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

例：某投资者持有 10 万份本基金基金份额，持有 180 天后在场外（场内）赎回，赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元，则其可得到的赎回金额为：



赎回总额 =  $100,000 \times 1.0150 = 101,500.00$  元

赎回费用 =  $101,500 \times 0.25\% = 253.75$  元

赎回金额 =  $101,500 - 253.75 = 101,246.25$  元

即投资者持有 10 万份基金份额，持有 180 天后在场外（场内）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元，则其可得到的赎回金额为 101,246.25 元。

### 3、基金份额净值的计算

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。

#### （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受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、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。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时。
- 8、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值并采取暂停接受基金申购申请的措施。
- 9、基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，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并公告。

#### （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。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。
- 6、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估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- 7、基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延期支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回申请，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

## 2、巨额赎回的处理方式

(1) 当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，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。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，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赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交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赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，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) 若基金发生巨额赎回且存在出现单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 20%的赎回申请(“大额赎回申请人”)情形下，基金管理人有权按照保护其他赎回申请人(“小额赎回申请人”)利益的原则，优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体措施为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。对该等大额赎回申请人当日未予确认的部分，在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的赎回申请将被撤销。选择延期赎回的，当日未获处理的赎回申请将自动转入下一个开放日继续赎回，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，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，直至全部赎回为止。如大额赎回申请人在提交赎回申请时未作明确选择，大额赎回申请人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(2) 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照上海证券交易所和登记机构的有关业务规则办理，基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则届时开展转换业务的公告。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的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。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述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，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

#### (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近 1 个工作日的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### (十二) 基金转换

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

#### (十三) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形

而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### (十四) 基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

##### 1、基金份额的登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额登记在登记结算系统中基金份额持有人的开放式基金账户下;场内申购的基金份额,以及上市交易买入的基金份额,登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。

(2) 登记在证券登记系统中的基金份额,可以在上海证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回,或经跨系统转托管至登记结算系统后申请场外赎回。

(3) 登记在登记结算系统中的基金份额,既可以直接申请场外赎回,也可经跨系统转托管至证券登记系统后,在上海证券交易所上市交易。

##### 2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间进行转登记的行为。

(2) 本基金系统内转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

##### 3、跨系统转托管

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

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

#### （十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十六）基金份额的转让

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

#### （十七）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。

## 十、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过精选个股优化指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），权证、股指期货、国债期货、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有的风险。

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。

### (三) 投资策略

本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。

#### 1、资产配置策略

本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成

份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金将采用指数化投资为主，增强型投资为辅的方式，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究及分析谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。

## 2、股票投资策略

本基金主要采用指数增强投资策略，参考目标股票指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，并通过精选个股策略优化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，使指数优化组合与标的指数的跟踪误差控制在限定的范围内。

### （1）标的指数

本基金标的指数上证 50 指数是由中证指数有限公司编制，上海证券交易所授权，它的样本选自沪市 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 50 只股票，反映上海证券市场最具影响力的一批龙头公司的股票价格表现。

### （2）指数化投资策略

本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

### （3）增强投资策略

本基金将以基本面分析为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。

基金管理人将根据历史数据和市场状况，对投资组合进行检验和改进，力争保持策略的有效和稳定，为投资决策提供支持。

本基金依据国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，基于上市公司及行业的基本面分析，适度对指数化投资组合进行优化，具体



而言主要是考虑以下因素：

1) 公司基本面及竞争优势。本基金主要根据研究员的深度调研，分析上市公司的基本面状况和竞争优势，对每只股票的盈利增长能力和盈利的可持续性进行分析判断和预测。

2) 股票相对价值。本基金主要基于不同行业的特点，并通过同行业比较、历史比较和成长性分析，努力发现那些与其同类个股或其本身所具有的盈利预期相比价格被相对低估的上市公司。

3) 个股的市场机会和趋势。本基金还将基于对上市公司的深度调研和对股价可能产生显著影响的市场信息的充分挖掘，分析个股的短期投资机会。

4) 股票的流动性。本基金主要根据对当时市场成交活跃程度及股票过往的平均换手率、交易量等因素的分析，对个股的流动性进行分析预测。

5) 提前或延后指数成分股的变更。本基金将根据指数编制人制定的指数编制规则，预测指数成分股可能发生的变动以及对股价的影响，提前或延后调整成分股。

6) 非成分股及备选成分股的投资。本基金将及时把握一级市场上比较明确的盈利机会，在不增加额外风险的前提下，参与新股认购与增发认购，以提高收益水平。当研究发现个别基本面较好、股价被远远低估、存在重大投资机会的股票时，本基金也将适度参与这些非成分股及备选成分股的二级市场投资。

### 3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线、利差策略等为辅，构造能够提供稳定的债券和货币市场工具组合。

在中小企业私募债投资方面，由于中小企业私募债具有票息收益高、信用风险高、流动性差、规模小等特点，本基金将在市场条件允许的情况下进行择优投资。利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。由于中小企业私募债的发行主体多为非上市民营企业，个体异质性强、信息少且透明度低，因此在投资研究方面主要采用逐案分析的方法（Case-by-case），通过尽职调查进行独立评估，信用分析以经营风险、财务风险

和回收率（Recovery rate）等指标为重点。此外，针对中小企业私募债的投资，基金管理人将根据审慎原则，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### 4、资产支持证券投资策略

依据风险可控和优化组合风险收益的原则，投资于资产支持证券产品，以期获得长期稳定的收益。坚持价值投资理念，综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资计划，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化、把握市场交易机会，积极调整投资策略。

#### 5、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，合理利用股指期货、国债期货等衍生工具，发掘可能的套利机会。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 6、权证投资策略

本基金的权证投资策略，一方面投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益；同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主动进行部分权证投资。今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

#### 7、跟踪误差的监控与管理

本基金为增强指数型基金，通过适度的主动投资获取超出投资标的超额收益，同时也承担相应偏离标的指数导致跟踪误差较大的风险。

本基金将密切关注基金的实际跟踪误差，及时调整基金投资组合，在控制跟踪误差的前提下尽可能获取超额收益“阿尔法”。

#### 8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融

通证券出借业务。

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

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

#### （四）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（6）本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；

（7）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%；

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

（9）本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押

式回购)等;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;

3) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;本基金在任何交易日日终,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%;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;本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%;

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例范围为 80%-95%;

(10) 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;

(11) 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%;

(12) 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%;

(13) 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%;

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

(15) 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。本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三个月内全部卖出;

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

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

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

(19) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(20) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 30%; 但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制;

(21) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%;

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合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;

(22) 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;

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

(24) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其它投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 除上述第 (2)、(15)、(21)、(22) 条外, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

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

法律、行政法规或监管部门取消上述限制,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。

## (五) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理。

3、有利于基金财产的安全与增值。

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

## (六) 标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为中证指数有限公司发布的上证 50 指数。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  上证 50 指数收益率 $+5\% \times$  同期银行活期存款利率（税后）

如果出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

#### （七）风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

#### （八）基金投资组合报告

本报告期为 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,367,651.03	92.17
	其中：股票	23,367,651.03	92.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,779,616.21	7.02
8	其他资产	206,448.42	0.81
9	合计	25,353,715.66	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

## (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	-	-
B	采矿业	773,682.00	3.14
C	制造业	7,669,063.00	31.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	502,466.00	2.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	318,906.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	423,298.00	1.72
J	金融业	9,807,184.46	39.77
K	房地产业	382,802.00	1.55
L	租赁和商务服务业	539,105.00	2.19
M	科学研究和技术服务业	361,284.00	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,777,790.46	84.27

注：以上行业分类以 2019 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,120.00	0.02
C	制造业	1,813,552.57	7.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,810.00	0.08
E	建筑业	72,790.00	0.30
F	批发和零售业	77,888.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政	147,690.00	0.60



	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,137.00	0.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	154,506.00	0.63
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,752.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	53,615.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	2,589,860.57	10.50

注：以上行业分类以 2019 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### (3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	39,200	2,798,880.00	11.35
2	600519	贵州茅台	1,900	2,779,472.00	11.27
3	600036	招商银行	37,300	1,257,756.00	5.10
4	600276	恒瑞医药	13,420	1,238,666.00	5.02
5	600030	中信证券	30,800	742,588.00	3.01
6	601166	兴业银行	45,100	711,678.00	2.89
7	600887	伊利股份	22,000	684,860.00	2.78
8	601398	工商银行	126,900	631,962.00	2.56
9	601888	中国中免	3,500	539,105.00	2.19
10	601328	交通银行	99,500	510,435.00	2.07

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例 (%)
1	603288	海天味业	1,200	149,280.00	0.61
2	002352	顺丰控股	2,700	147,690.00	0.60
3	001979	招商蛇口	6,200	101,928.00	0.41
4	600809	山西汾酒	700	101,500.00	0.41
5	688186	广大特材	2,926	99,922.90	0.41

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### (1) 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

##### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资国债期货。

##### (3) 本期国债期货投资评价

注：报告期内，本基金未参与国债期货交易。

#### 11、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券于 2019 年 7 月

16 日收到中国证券监督管理委员会采取出具警示函监管措施的决定。主要违法违规事实：（一）在保荐上海柏楚电子科技股份有限公司科创板首发申请过程中以落实“对招股说明书披露内容进行整理和精炼”的问询问题为由，对前期间询要求披露的“综合毛利率、销售净利率及净资产收益率大幅高于同行业可比上市公司，期间费用率远低于同行业可比上市公司等事项的差异原因分析”等内容在招股说明书注册稿（6月28日）中擅自进行了删减。（二）从7月1日到3日提交的7版招股说明书注册稿及反馈意见落实函的签字盖章日期均为2019年7月1日，日期签署与实际时间不符。

交通银行股份有限公司于2020年1月8日收到银保监会行政处罚，罚款合计150万元，主要违法违规事实：（一）授信审批不审慎；（二）总行对分支机构管控不力承担管理责任。交通银行股份有限公司于2020年5月9日收到银保监会行政处罚，罚款合计260万元，主要违法违规事实：交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为，（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。

中国工商银行股份有限公司于2020年5月9日收到银保监会行政处罚，罚款合计270万元，主要违法违规事实：工商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为，（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）信贷资产转让业务漏报；（四）贷款核销业务漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）委托贷款业务应报未报；（八）关键且应报字段漏报或填报错误。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	58,907.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	191.77
5	应收申购款	147,349.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,448.42

(4) 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688186	广大特材	99,922.90	0.41	锁定期股票流通受限

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## 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及其更新。

### 一、基金净值表现

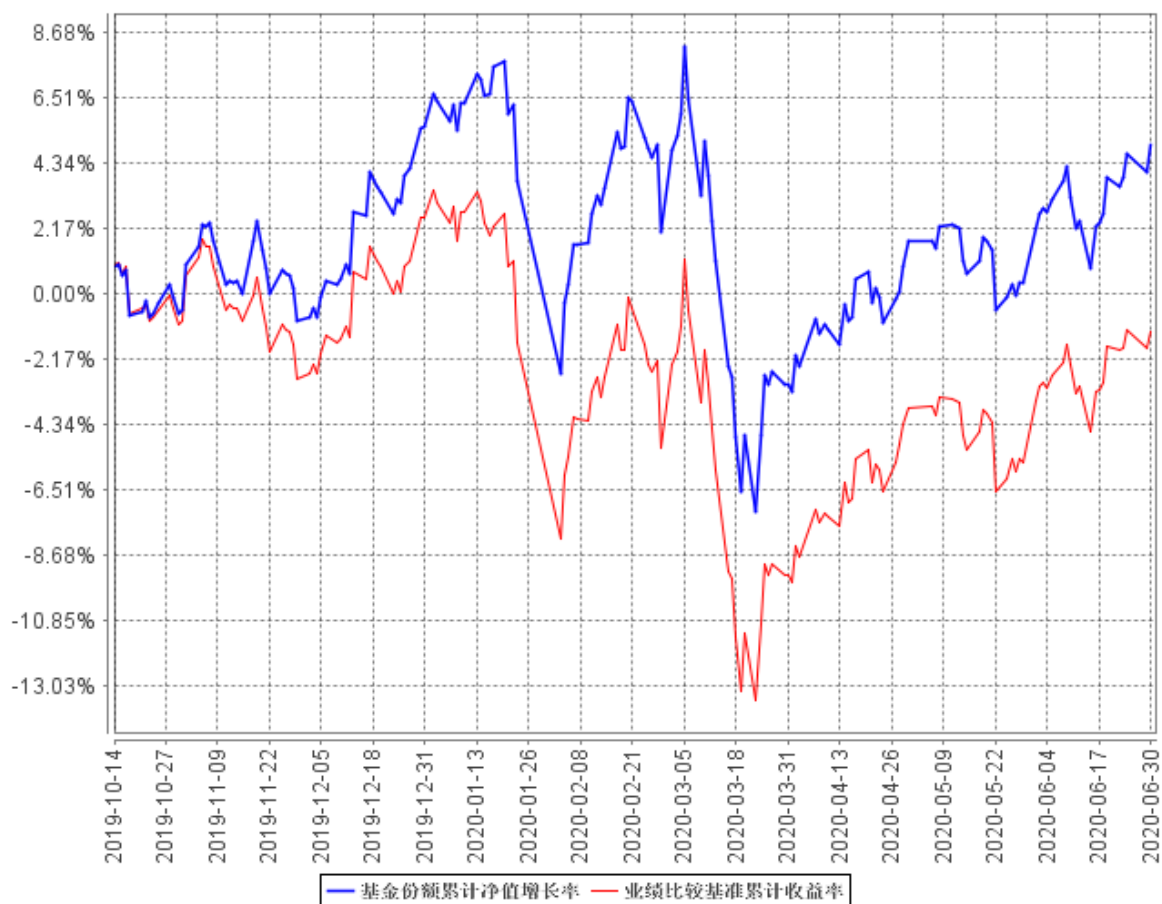
1、本基金合同生效日为 2019 年 10 月 14 日，基金合同生效以来（截至 2020 年 6 月 30 日）的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较如下表所示：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
合同生效日至 2019 年 12 月 31 日	5.55%	0.71%	2.56%	0.70%	2.99%	0.01%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	-0.59%	1.26%	-3.70%	1.34%	3.11%	-0.08%
合同生效日至 2020 年 6 月 30 日	4.93%	1.11%	-1.23%	1.17%	6.16%	-0.06%

注：本基金的业绩比较基准为：上证 50 指数收益率\*95%+人民币银行活期存款收益率(税后)\*5%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 14 日，图示日期为 2019 年 10 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项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、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### (三) 估值方法

##### 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；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。

(3) 交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价。

(4) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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。



3、全国银行间债券市场上不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；全国银行间债券市场上含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日期（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约按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。

6、国债期货合约按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、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

8、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

9、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

10、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

11、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

12、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。

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

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

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

#### （四）估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （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、登记机构、销售机构、投资者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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下

述规定执行。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行

更正和赔偿损失；

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(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。如果行业另有通行做法，基金管理人及基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、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资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人将基金份额净值予以公布。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据

错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、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）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

- 1、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额的收益分配方式仅为现金分红，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，由基金管理人或销售机构承担。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

## 十四、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

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

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$



H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、基金的标的指数使用许可费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的指数的使用许可费率年费率为 0.016%。标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用许可费收取下限为每季度 4 万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方签署的指数使用协议约定的费率、计算方式、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、计算方式、支付方式执行。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4—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。

#### （三）不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、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。

## 十六、基金的信息披露

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

### （二）信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人还应当根据上海证券交易所的自律管理规则披露基金信息。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

### 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的,基金管理人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。

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

基金管理人将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

### 2、上市交易公告书

本基金获准在上海证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前,将上市交易公告书登载在指定媒介上。

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当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、赎回价格

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

#### 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

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

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

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

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

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本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

#### 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) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、标的指数许可使用费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (16) 基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
- (17) 本基金开始办理申购、赎回；

- (18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (21) 本基金调整基金份额类别的设置；
- (22) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (23) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (24) 本基金变更标的指数；
- (25) 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及上海证券交易所。

#### 8、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### 9、资产支持证券投资情况

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### 10、股指期货合约的投资情况

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

#### 11、国债期货合约的投资情况



本基金投资国债期货，基金管理人需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### 12、中小企业私募债的投资情况

本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### 13、非公开发行股票的投资情况

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

#### 14、参与融资及转融通证券出借业务的信息披露

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

#### 15、中国证监会规定的其他信息。

##### （六）信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金

信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、上海证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### （八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十七、风险揭示

本基金存在的主要风险有：

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

### （三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （四）流动性风险

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

(1) 本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所,主要投资对象为具有良好流动性的金融工具(包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等),同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征,综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。极端市场情况下,前述金融工具可能出现流动性不足,导致基金资产无法变现,从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计,绝大部分时间上述金融工具流动性充裕,流动性风险可控,当遇到极端市场情况时,基金管理人将按照基金合同及相关法律法规要求,及时启动流动性风险应对措施,保护基金投资者的合法权益。

#### (2) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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、延缓支付赎回款项、暂停赎回或部分延期赎回。基金管理人根据相关内部管理制度与法律法规的要求执行对于本基金巨额赎回的事前监测、事中管控与事后评估机制。当本基金发生基金合同约定的巨额赎回且现金类资产不足以支付赎回款项时,基金管理人在当日接受赎回申请比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,通过压力测试等手段充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动,对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,审慎接受、确认赎回申请,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例情形下的流动性风险管理措施:

如本基金发生巨额赎回且存在出现单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过前一开放日基金总份额 20% 的情形,基金管理人可以通过压力测试等手段充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动,审慎办理并部分确认该单个基金份额持有人的赎回申请,并可对于其余未

办理赎回申请部分延期至下一个开放日办理。如下一开放日基金管理人经评估认为其余未办理赎回申请部分如全部办理支付相应赎回款项仍有困难或认为因支付相应赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动或存在将对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的其他情形的,基金管理人可决定将部分赎回申请继续延期至下一个开放日办理,直到该单个基金份额持有人的赎回申请全部赎回为止。

(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  
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,可以综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及中国证监会认定的其他措施。基金管理人应当围绕前述工具的实施条件、发起部门、决策程序、业务流程等事项,制定清晰的内部制度并定期更新,确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。

#### 1) 延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项

如依照法律法规及基金合同的约定本基金发生需延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项的情形,经本基金基金经理发起,经基金管理人管理层决定,并经与基金托管人协商一致后,基金管理人可以实施相关流动性管理工具,并依据法律法规及基金合同的约定进行信息披露。在前述情况下,投资者的赎回申请将不被基金管理人接受或全部办理,或投资者赎回申请对应的赎回款项金额发生变动或赎回款项到达投资者银行账户时间发生延迟,将对投资者的预期资金安排产生一定影响。

#### 2) 收取短期赎回费

依照法律法规及基金合同的约定,本基金对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产,将对投资者赎回申请对应的赎回款项金额产生一定影响。

#### 3) 暂停基金估值

如依照法律法规及基金合同的约定本基金发生需暂停基金估值的情形,经本基金基金经理发起,经基金管理人管理层决定,并经与基金托管人协商一致后,

基金管理人可以暂停基金估值,并依据法律法规及基金合同的约定进行信息披露。在前述情况下,基金管理人可暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项,投资者的赎回申请将不被基金管理人接受,或赎回申请对应的赎回款项到达投资者银行账户时间发生延迟,将对投资者的预期资金安排产生一定影响。

#### 4) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则规定。

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

### (五) 基金间转换所产生的风险

在基金间转换时,可能使相关的基金的规模发生较大改变,从而对转出和转入基金的原持有人利益产生影响。

### (六) 本基金特有的风险

#### 1、指数化投资风险

##### (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

##### (2) 标的指数波动的风险

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

##### (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

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

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率,

产生跟踪误差。

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

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费和托管费等的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度和跟踪误差。

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

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;如未来法律法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差;因基金申购与赎回带来的现金变动等;因指数发布机构指数编制错误等,由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### (4) 标的指数变更的风险

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

#### (5) 指数编制方案变更风险

标的指数的编制方案存在变更的可能,从而引发指数成份股及权重发生较大调整,进而增加基金投资成本和跟踪误差,对基金净值表现产生影响。

#### (6) 标的指数成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份股停牌时可能面临如下风险:

- 1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。
- 2) 若成份股停牌时间较长,在约定时间内仍未能及时买入或卖出的,由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。
- 3) 在极端情况下,标的指数成份股可能大面积停牌,基金可能无法及时卖

出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价,由此基金管理人可能在申购赎回中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### (7) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5%以内,年化跟踪误差控制在 8%以内,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### (8) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

#### (9) 标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性,但不对此作任何保证,亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此,如果标的指数值出现错误,投资人参考指数值进行投资决策,则可能导致损失。

#### (10) 主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略,为了获得超越业绩比较基准的投资回报,可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整,如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面研究及数量化投资分析技术等方法作出优化调整投资组合的决策,最终结果仍然存在一定的不确定性,其投资收益率可能高于指数收益率,但也有可能低于指数收益率。



### (11) 上市交易风险

基金合同生效后,本基金将在上海证券交易所上市交易,由于上市期间可能因各种原因导致停牌,投资者在停牌期间不能买卖本基金,产生风险;同时,可能因上市后流动性不足导致流动性风险。

### 2、中小企业私募债投资风险

本基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降,可能造成受托财产损失。此外,受市场规模及交易活跃程度的影响,中小企业私募债券/非公开发行人公司债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险,从而对本基金收益造成影响。

### 3、股指期货/国债期货投资风险

#### (1) 基差风险

基差风险是期货市场的特有风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险,以及期货合约价格和标的指数价格之间价格差异的波动造成的风险,不同期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

#### (2) 流动性风险

流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以合理的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

#### (3) 保证金风险

保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险

#### (4) 合约品种差异风险

合约品种差异造成的风险,是指类似的合约品种,在相同因素的影响下,价格变动不同。表现为两种情况:

- 1) 价格变动的方向相反;
- 2) 价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格,在相同因素作用下变动幅

度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。

#### （5）标的物风险

期货交易中，标的物风险是由于投资组合与期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。

#### （6）衍生品模型风险

本基金在构建期货组合时，可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计、资本市场的剧烈波动或不可抗力，按模型结果调整期货合约或者持仓比例也可能将给本基金的收益带来影响。

#### （7）合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

#### （8）强制平仓或止损风险

使用衍生品投资工具，有可能面临投资期内，价格反向波动过大导致的强制平仓或止损，比如结构化产品挂钩标的价格下跌超过一定程度触发止损条款，或期货保证金头寸不足导致强制平仓，在此情况下，委托资产将被迫产生损失，且日后标的资产价格回归也可能无法挽回全部已实现损失，对基金收益影响较大。

#### （9）国债期货交割风险

交割风险是指在期货合约到期前不能及时完成对冲操作时，需要以足够的资金或者实物货源进行交割所产生的风险。

### 4、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

#### （七）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险。
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险。
- 3、因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险。
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险。
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险。
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。
- 7、其他意外导致的风险。

## 十八、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生效后方可执行，并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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

##### （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具有证券、期货相关业务资格的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，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。

##### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金管理人简况

名称：国金基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

法定代表人：尹庆军

成立日期：2011 年 11 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]1661 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 3.6 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：010-88005888

#### (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金。

(2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产。

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

(4) 销售基金份额。

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会。

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人。

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理。

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记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。

(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、期货经纪机构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申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则。

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、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、赎回的价格。

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

(10) 编制基金定期报告,包括季度报告、中期报告和年度报告。

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项。

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上。

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件。

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基



金事务的行为承担责任。

（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）执行生效的基金份额持有人大会的决议。

（25）建立并保存基金份额持有人名册。

（26）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### （三）基金托管人简况

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复[1996]14 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2004]101 号

### （四）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，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益。

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

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会。
- (6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人。
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产。
- (2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜。
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产。
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证。
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户, 按照基金合同的约定, 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、赎回价格。
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度基金报告出具意见, 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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册。

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对。

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

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

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作。

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人。

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿。

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议。

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### (五) 基金份额持有人权利义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益。

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产。

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额。

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会。

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权。

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料。

(7) 监督基金管理人的投资运作。

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁。

(9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件。

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务。

(4) 缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用。

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任。

(6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动。

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议。

(8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利。

(9) 单一投资者持有基金份额的比例不得达到或超过 50%，且不得通过二级市场交易等基金管理人无法予以控制的方式，或通过一致行动人等方式变相规避本基金单一投资者持有份额集中度不得达到或者超过 50% 的要求（但因其他投资者赎回等客观因素致使持有的基金份额比例不符合前述要求的除外）。

(10) 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。

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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，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。
- (2) 更换基金管理人。
- (3) 更换基金托管人。
- (4) 转换基金运作方式。
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准。
- (6) 变更基金类别。
- (7) 本基金与其他基金的合并。
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略。
- (9) 变更基金份额持有人大会程序。
- (10) 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) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外。

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更或增加收费方式；

(3) 根据标的指数供应商对相应指数使用许可协议的调整变更标的指数许可使用费率、计费方式和支付方式等；

(4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而对基金合同进行的修改；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;

(6) 在法律法规规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下基金推出新业务或服务;

(7) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集。

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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、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方式、通讯开会方式或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式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小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书



面意见。

(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。

3、在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

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

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表

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

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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生效后方可执行，并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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、基金合同约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（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具有证券、期货相关业务资格的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，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。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金

合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：国金基金管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

邮政编码：100089

法定代表人：尹庆军

成立日期：2011 年 11 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]1661 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3.6 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

法定代表人：洪崎

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），权证、股指期货、国债期货、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有的风险。

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。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投



资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

#### 1. 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(6) 本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；

(7) 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%；

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

(9) 本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，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%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本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%；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例范围为 80%-95%；

(10) 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；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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%；

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

(15) 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。本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三个月内全部卖出；

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

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

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

(19) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(20) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组

合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

（21）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合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；

（22）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；

（23）本基金投资流通受限证券，需遵循如下比例限制：

- 1) 本基金不得投资锁定期超过 12 个月的证券；
- 2) 本基金持有的单个流通受限证券的市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 3) 本基金持有的全部流通受限证券的市值不得超过该基金资产净值的 10%。

（24）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其它投资限制。

因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（15）、（21）、（22）条外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券。

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

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

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，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。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承

担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人应积极采取应对措施。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

基金管理人投资流通受限证券,应事先根据中国证监会相关规定,明确基金投资流通受限证券的比例,制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

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

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

本基金投资流通受限证券,不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人违反基金合同或

预先确定的投资流通受限证券的比例导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

4. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

3) 有关比例限制的执行情况。

4) 信息披露情况。

5. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定了经公司董事会批准的基金投资中期票据相关制度（以下简称“《制度》”），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。1. 基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

(1) 中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及基金合同中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例及期限限制；

(2) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%。

2. 基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

3. 如因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个交易日内将中期票据调整至规定的比例要求。

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

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

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

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

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、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、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

1. 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。

2. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。

4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管



理，确保基金财产的完整与独立。

5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

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

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

#### （二）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2. 基金托管人应以本基金名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

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

4. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

#### （三）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

3. 基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以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，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### （四）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （五）其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （六）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人及基金托管人委托保管的机构以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任，但基金托管人应妥善保管保管凭证。

#### （七）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人

保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值的计算和会计核算

### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

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

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

### 2. 复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果以双方约定的方式提交给基金托管人，经基金托管人复核无误后，以约定的方式将复核结果提交给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规对外公布。

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

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

因本托管协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，

协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对本托管协议双方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，本托管协议双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）本托管协议的变更程序

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对本托管协议进行修改。修改后的新托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供以下一系列服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及基金管理人服务能力的变化，增加、修改服务项目：

### （一）基金份额持有人登记服务

基金管理人或者其委托的登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户与基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人将为基金份额持有人提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道定期定额申购基金份额。具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公布的业务规则为准。

### （三）资讯服务定制

为使基金份额持有人及时了解基金资讯，基金管理人推出全方位资讯服务定制项目。场外基金份额持有人可通过客服热线、基金管理人网站定制基金净值、电子对账单等各种服务，基金管理人通过电子邮件、短信等多渠道发送所定制的信息。

### （四）客户服务中心电话服务

为方便基金份额持有人随时了解基金管理人相关信息及投资资讯，基金管理人开通客服热线（4000-2000-18），自动语音服务提供 7×24 小时场外基金份额持有人交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

基金管理人开设人工座席，在每个交易日（工作时间 9:00-17:00）提供人工咨询服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、建议与投诉等服务，场外基金份额持有人还可以通过该热线获得信息定制、资料修改、索取对账单等专项服务。场内基金份额持有人可通过场内销售机构了解账户交易信息。

投资人也可通过客服热线进行语音留言，客户服务人员将及时进行处理。

#### （五）网络在线服务

通过基金管理人网站（www.gfund.com），场外基金份额持有人可享有基金交易、账户查询和基金信息查询服务。

投资人可通过基金管理人网站获取本基金管理人和基金的各类信息，包括基金合同等的法律文件、基金公告、业绩报告、直销业务表单和基金管理人最新动态等各类最新资料。也可登录基金管理人网站的在线客服，可以与客户服务人员进行网上一对一答疑解惑。

#### （六）投诉建议受理

投资人如果对基金管理人提供的各种服务感到不满意或有其他需求，可通过语音留言、传真、电子邮件、邮寄等各种方式随时向基金管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉。

#### （七）基金管理人客户服务中心联系方式

客户服务电话：4000-2000-18

网址：www.gfund.com

客户服务电子信箱：service@gfund.com

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

## 二十二、其他应披露事项

自 2020 年 8 月 1 日至 2021 年 3 月 29 日，本基金的相关公告登载于《证券日报》和本公司官网。

序号	公告事项	披露日期
1	《国金上证 50 指数增强证券投资基金(LOF)2020 年中期报告》	2020 年 8 月 27 日
2	《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）》	2020 年 8 月 28 日
3	《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）产品资料概要（更新）》	2020 年 8 月 28 日
4	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	2020 年 9 月 19 日
5	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	2020 年 10 月 17 日
6	《国金上证 50 指数增强证券投资基金(LOF)2020 年第 3 季度报告》	2020 年 10 月 28 日
7	《国金基金管理有限公司关于大泰金石基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告》	2020 年 10 月 29 日
8	《国金基金管理有限公司关于提示投资者持续完善身份信息资料的公告》	2020 年 12 月 11 日
9	《国金基金管理有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司、深圳盈信基金销售有限公司和泰诚财富基金销售（大连）有限公司投资者基金份额转托管的公告》	2020 年 12 月 24 日
10	《国金上证 50 指数增强证券投资基金(LOF)2020 年第 4 季度报告》	2021 年 1 月 22 日
11	《国金基金管理有限公司关于旗下指数基金指数	2021 年 2 月 1 日

	信息查询路径的公告》	
12	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》	2021 年 3 月 18 日



### 二十三、招募说明书存放及查阅方式

招募说明书分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资人可在办公时间查阅、复制；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（[www.gfund.com](http://www.gfund.com)）查阅和下载招募说明书。

## 二十四、备查文件

（一）本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会准予本基金变更注册的文件。
- 2、《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、《国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）托管协议》。
- 4、关于申请本基金变更注册的法律意见书。
- 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。
- 7、注册登记协议。
- 8、中国证监会要求的其他文件。

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式

1、存放地点：基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

国金基金管理有限公司

二〇二一年三月三十一日