

# 泰信中证 200 指数证券投资基金 更新招募说明书

(2022 年 1 号)

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

本报告送出日期：二〇二二年三月

## 重要提示

本基金根据 2011 年 4 月 12 日中国证券监督管理委员会《关于核准泰信中证 200 指数证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】534 号）和 2011 年 4 月 26 日《关于泰信中证 200 指数证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2011】256 号）的核准，进行募集。

本基金为契约型开放式，基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。基金管理人及注册登记机构为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金标的指数为中证 200 指数。指数编制方法为：沪深 300 指数成份股中非中证 100 指数样本股的 200 家公司股票构成中证 200 指数样本股。其选样空间为：

- 1、上市交易时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；
- 2、非 ST、\*ST、非暂停上市股票；
- 3、公司经营状况良好，最近一年无重大违法违规事件、财务报告无重大问题；
- 4、股票价格无明显的异常波动或市场操纵；
- 5、剔除其它经专家委员会认定不能进入指数的股票。

中证 200 指数以调整股本为权重，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。其中，调整股本根据分级靠档方法获得。当沪深 300、中证 100、中证 500 指数调整样本股时，中证 200 随之进行相应的调整。

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，网址：  
[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险，投资人认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时

机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本更新招募说明书有关财务数据（未经审计）和投资组合数据的截止日为 2021 年 12 月 31 日，净值表现数据的截止日期为 2021 年 12 月 31 日，除非另有说明，其他所载内容截止日期为 2022 年 2 月 28 日。原招募说明书与本更新招募说明书不一致的，以本更新招募说明书为准。

## 目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	13
五、相关服务机构.....	15
六、基金份额的申购、赎回与转换.....	43
七、基金的转换、非交易过户及转托管.....	50
八、基金的投资.....	52
九、基金的业绩.....	64
十、基金的财产.....	66
十一、基金资产的估值.....	67
十二、基金的收益分配.....	70
十三、基金的费用与税收.....	71
十四、基金的会计与审计.....	73
十五、基金的信息披露.....	74
十六、风险揭示.....	77
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	82
十八、基金合同的内容摘要.....	84
十九、基金托管协议的内容摘要.....	95
二十、对基金份额持有人的服务.....	104
二十一、其他应披露事项.....	108

二十二、招募说明书的存放及查阅方式 .....	110
二十三、备查文件.....	110

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金	指泰信中证 200 指数证券投资基金
基金合同	指《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》及其任何有效的修订和补充
中国	指中华人民共和国(仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
《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，2012 年 12 月 28 日经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
《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
《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
《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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《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
《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
《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

元	指中国法定货币人民币元
招募说明书	指《泰信中证 200 指数证券投资基金招募说明书》及对该招募说明书的任何修订和补充，包括依据法律法规对该招募说明书进行的更新
基金产品资料概要	指《泰信中证 200 指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
发售公告	指《泰信中证 200 指数证券投资基金份额发售公告》
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《泰信中证 200 指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
业务规则	指《泰信基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	指泰信基金管理有限公司
基金托管人	指中国银行股份有限公司
代销机构	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为泰信基金管理有限公司或接受泰信基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构
基金合同当事人	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
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的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的总称



基金合同生效日	指基金募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日
募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月
基金存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日、交易日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指销售机构办理本基金申购、赎回等业务的工作日
T 日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为
申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
基金账户	指基金份额注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	指投资者将其持有的基金份额从某一销售机构转托管另一销售机构的业务
基金转换	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、并由同一基金份额注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为

定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他已实现的合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
基金资产总值	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以该计算日发行在外的基金份额总数后的值
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	指现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具
规定媒介	指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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
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
不可抗力	指任何无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

## 三、基金管理人

### （一）基金管理人概况

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：万众

总经理：高宇

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2022 年 2 月末，公司有正式员工 99 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2022 年 2 月末，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 400、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信双债增利债券、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式共 28 只开放式基金及 33 个

资产管理计划。

## （二）注册资本、股权结构

泰信基金管理有限公司注册资本 2 亿元人民币。其中，山东省鲁信投资控股集团有限公司出资 9000 万元，占公司总股本的 45%；江苏省投资管理有限责任公司出资 6000 万元，占公司总股本的 30%；青岛国信实业有限公司出资 5000 万元，占公司总股本的 25%。

股东单位名称	现金出资金额	股权比例
山东省鲁信投资控股集团有限公司	9000万元	45%
江苏省投资管理有限责任公司	6000万元	30%
青岛国信实业有限公司	5000万元	25%
合计	2亿元	100%

## （三）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、及其他高级管理人员的基本情况

#### （1）董事会成员

万众先生，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省鲁信实业集团有限公司副总经理、总经理、董事长，山东省国际信托股份有限公司副总经理、总经理，山东省鲁信投资控股集团有限公司总经理助理。现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理，山东省国际信托股份有限公司党委书记、董事长。

校登楼先生，副董事长，高级会计师，注册会计师，本科；曾任江苏省国际信托投资公司证券部副科长，江苏省国信集团审计部部长、项目经理、高级经理，江苏省投资管理有限公司财务部副总经理。现任江苏省投资管理有限责任公司风险控制部总经理。

高宇先生，董事、总经理，中级经济师，经济学博士；曾任沈阳市轻工业管理局办公室职员，中国银行股份有限公司上海市分行资金计划处科长、中国银行股份有限公司交易中心（上海）副总经理，花旗银行（中国）有限公司金融市场部总监，光大证券股份有限公司证券投资总部副总经理、金融市场总部副总经理（主持工作）、金融市场总部总经理、金融市场总部董事总经理、权益投资交易部董事总经理。现任泰信基金管理有限公司董事、总经理。

王静玉先生，董事，高级经济师，国际金融硕士；曾任青岛国信发展（集团）有限责任公司资产管理部职员，青岛国信金融控股有限公司研究发展部副经理，青岛国信资本投资有限公司副总经理等。现任青岛国信金融控股有限公司副总经理，青岛国信资本投资有限公司董事，青岛国信创业小额贷款有限公司董事，青岛国信融资担保有限公司董事，久实融资租赁有限公司董事，久实融资租赁（上海）有限公司董事，山东港信期货有限公司董事。

王川先生，独立董事，高级经济师，经济学管理学大专；曾任山西省委政策研究室干部、省委办公厅秘书，中国农业银行办公室秘书、综合处副处长、人事教育部副主任、研究室副主任、信贷业务部主任、吉林分行行长兼党组书记、党组成员兼纪检组组长、副厅长兼党组成员（党委委员）、副厅长兼党委副书记，中国光大（集团）总公司副董事长、党委副书记兼中国光大银行副董事长、行长，中国中信集团公司副董事长、党委委员、中信（金融）控股总裁。

郝亮先生，独立董事，本科；曾任中国建设银行青岛市支行副行长、分行办公室副主任，青岛市住房公积金管理中心副主任，深圳大通实业股份有限公司董事会秘书、副董事长、董事长。现任大通金控（青岛）投资管理有限公司董事长。

李华强先生，独立董事，经济学硕士；曾任中国有色金属工业总公司株洲冶炼厂总经理，深圳科技工业园总公司总经理助理，国信证券股份有限公司副总经理，浙江（方正）证券股份有限公司董事长、党委书记兼总裁，华西证券股份有限公司副总裁，华林证券股份有限公司总裁、党委副书记，中央汇金投资有限责任公司副董事长。现任华林证券董事及第二届董事会风险控制委员会主任委员和战略与规划委员会委员，现代投资股份有限公司独立董事。

## （2）监事会成员

武琳琳女士，监事会主席，工商管理硕士；曾任青岛国信实业有限公司投资管理部职员、青岛国信发展（集团）有限责任公司资本运营部主管、青岛国信发展资产管理有限公司副总经理。现任青岛国信金融控股有限公司董事兼副总经理，青岛国信资本投资有限公司董事，青岛海洋创新产业投资基金有限公司董事，国信（青岛胶州）金融发展有限公司董事，青岛国信创业小额贷款有限公司董事，青岛国信融资担保有限公司董事，久实融资租赁有限公司法人、董事长兼总经理，久实融资租赁（上海）有限公司法人、董事长兼总经理，青岛清丰投资有限公司法人、执行董事，山东港信期货有限公司监事长。

葛航先生，监事，学士；曾任山东省国际信托有限公司租赁部高级业务经理、山东省国际信托有限公司自营业务部经理、上海锐懿资产管理有限公司执行董事、泰信基金管理有限公司总经理。现任山东省国际信托股份有限公司高级经理。

叶茂先生，监事，本科；曾任东方海外物流（中国）有限公司南京分公司项目经理、南京水门电子有限公司销售经理，江苏省投资管理有限公司资产管理部办事员。现任江苏省投资管理有限公司投资部。

周向光先生，职工监事，本科；2002 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，曾任综合管理部副经理、北京办事处主任、行政总监兼理财顾问部业务副总监。现任公司董事会秘书、董监事工作部主任、综合管理部副总监、工会主席。

张萍历女士，职工监事，硕士；2007 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司集中交易部总监。

胡因女士，职工监事，经济学硕士；2006 年加入泰信基金管理有限公司，曾任渠道部、客服中心，监察稽核部总监、上海锐懿资产管理有限公司监事。现任上海锐懿资产管理有限公司副总经理兼合规总监。

### （3）公司高级管理人员

万众先生，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省鲁信实业集团有限公司副总经理、总经理、董事长，山东省国际信托股份有限公司副总经理、总经理，山东省鲁信投资控股集团有限公司总经理助理。现任山东省鲁信投资控股集团有限公司副总经理，山东省国际信托股份有限公司党委书记、董事长。

高宇先生，董事，总经理，博士；曾任沈阳市轻工业管理局办公室职员，中国银行股份有限公司上海市分行资金计划处科长、中国银行股份有限公司交易中心（上海）副总经理，花旗银行（中国）有限公司金融市场部总监，光大证券股份有限公司证券投资总部副总经理、金融市场总部副总经理（主持工作）、金融市场总部总经理、金融市场总部董事总经理、权益投资交易部董事总经理。

刘小舫女士，督察长，硕士；曾任国泰基金管理有限公司监察稽核部信息披露专员，华夏基金管理有限公司风险管理部副总裁，新沃基金管理有限公司监察稽核部总监、督察长。

岳红婷女士，副总经理，硕士；曾任中国银行安徽省分行办公室、综合管理处、外汇信贷处科员、主任科员，中国银行资产管理总部上海分部交易所场内代表，华安证券股份有限公司研究所副经理，华富基金管理有限公司市场部副总监、专户部总监、公司总经理助理兼机构部总经理，德邦基金管理有限公司事业二部总监（公司总经理助理级）、公司总经理助理兼机构业务管理总部联席总经理兼机构业务一部总监、公司副总经理。

张秉麟先生，副总经理，上海锐懿资产管理有限公司董事长，硕士；曾任中银国际证券股份有限公司投资经理，瑞银证券有限责任公司自营主管、自营分公司总经理，申万宏源证券有限公司资管九总部总经理。

叶振宇先生，首席信息官，学士；曾任上海大学职员，光大证券张杨路营业部电脑部主管、资金计划部经理、清算中心经理、风险管理部经理、资产管理总部运营管理部副总经理、运营管理总部总经理助理、交易中心处长、交易中心总经理、金融市场总部董事、业务管理部总经理、风险控制部总经理，银领资产管理有限公司合伙人，璞基资本（筹）合伙人。

## 2、基金经理

董山青先生，香港大学工商管理专业硕士。曾任中国银行上海分行业务经理。2004 年 8 月加入

泰信基金管理有限公司，历任交易员、研究员、研究总监助理、基金经理助理，现任权益投资部总监助理。2012 年 2 月至今任泰信行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（原泰信保本混合型证券投资基金转型），2016 年 2 月至今任泰信鑫选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月至今任泰信蓝筹精选混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（LOF）基金经理（原泰信中证锐联基本面 400 指数分级证券投资基金转型），2021 年 8 月至今任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
张彦	2015 年 1 月 6 日至 2021 年 8 月 5 日
冯张鹏	2013 年 7 月 5 日至 2015 年 1 月 6 日
陈大庆	2011 年 6 月 9 日至 2013 年 7 月 5 日
刘毅	2011 年 6 月 9 日至 2012 年 12 月 28 日

### 3、投资决策委员会成员名单

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员：总经理高宇先生、分管投资副总经理张秉麟先生、权益投资部副总监兼基金经理董季周先生、固收投资部总监兼基金经理郑宇光先生、研究部总监兼基金经理吴秉韬先生、研究部副总监梁剑先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## （四）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度、中期和年度报告；

7、算并公告基金净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其他职责。

### （五）基金管理人的承诺

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

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

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

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

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如涉及上述事项的法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

#### 4、基金经理承诺

- （1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- （3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；



(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## (六) 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。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

(2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

(3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4) 重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### 2、内部控制的主要内容

#### (1) 控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立有独立董事参加的审计、合规与风险控制委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会等，负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

公司设督察长，履行职责的范围涵盖基金及公司运作的业务环节，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

#### (2) 风险评估

公司风险管理部和内部监察稽核人员定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度。

#### (3) 操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。各业务部门内部工作岗位分工合理、职

责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，设置风险管理部，分析和监控公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员和风险管理具有相对的独立性，内部稽核报告报董事长及中国证监会。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

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

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### **（三）证券投资基金托管情况**

截至 2021 年 12 月 31 日，中国银行已托管 982 只证券投资基金，其中境内基金 934 只，QDII 基金 48 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### **（四）托管业务的内部控制制度**

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

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

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

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

法定代表人：万众

总经理：高宇

成立日期：2003 年 5 月 23 日

电话：021-20899188

传真：021-20899060

联系人：岳红婷

网址：www.ftfund.com

##### (2) 泰信基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区广成街 4 号院 1 号楼 305、306 室

邮政编码：100032

电话：010-66215978

传真：010-66215968

联系人：魏洪亮

##### (3) 泰信基金管理有限公司深圳分公司

地址：深圳市福田区福田街道口岸社区福田南路 38 号广银大厦 18 层 C10

邮政编码：518000

电话：0755-33988759

传真：0755-33988757

联系人：魏洪亮

#### 2、销售机构

##### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

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

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

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

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

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

(5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(6) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼中信大厦

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：www.citicbank.com

(7) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：李民吉

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(8) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511-3

公司网站：www.bank.pingan.com

(11) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

公司网站：www.nbcb.com.cn

(12) 金华银行股份有限公司

注册地址：浙江省金华市金东区多湖街道浙江省金华市光南路 668 号

办公地址：浙江省金华市丹溪路 1388 号

法定代表人：徐雅清

客服电话：400-711-6668

网址：www.jhccb.com

(13) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：贺青

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(14) 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 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(15) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(16) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

网址：www.newone.com.cn

(17) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(18) 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：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



法定代表人：张佑君

客服电话：95558

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

(19) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

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

(20) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

客服电话：95553

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

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562 或 400-809-5562

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

(22) 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 楼

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

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

(23) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：高振营

客服电话：95351

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

(24) 万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

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

法定代表人：罗钦城

客服电话：95322

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

(25) 民生证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室

法定代表人：冯鹤年

客服电话：95376

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

(26) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：安志勇

客户服务电话：400-651-5988

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

(27) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号

办公地址：中国江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客服电话：95597

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

(28) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：95573 或 (0351)95573

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

(29) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：95525

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

(30) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 373 号 3 层

法定代表人：何伟

客服电话：4008-918-918

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

(31) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：林雯

客服电话：95399

网址：www.xsdzq.cn

(32) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511 转 8

网址：www.stock.pingan.com

(33) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

(34) 财信证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T3、T4 及裙房 718

办公地址：湖南省长沙市芙蓉区定王台街道芙蓉中路 80 号顺天国际财富中心第 24 层

法定代表人：刘宛晨

客服电话：95317

网址：www.cfzq.com

(35) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京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

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(36) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 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 或 400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

(37) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

客服电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

(38) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李峰

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(39) 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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

网址：www.sd.citics.com

(40) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：丛中

客服电话：95335

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

(41) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层

办公地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 4 层、18-21 层

法定代表人：高涛

客服电话：95532

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

(42) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人：武晓春

客户服务电话：400-8888-128

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

(43) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 3 6 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：王作义

客户服务电话：95372

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

(44) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号楼

办公地址：上海市徐汇区东湖路 7 号 9 幢

法定代表人：郑立坤

客户服务电话：95357

网址：www.xzsec.com

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

法定代表人：王献军

客户服务电话：95523

网址：www.swhysc.com

(46) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：中国北京市西城区金融大街 17 号中国人寿中心 11 楼

法定代表人：庞介民

客服电话：956088

网址：www.cnht.com.cn

(47) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 2902 室

法定代表人：赵洪波

客服电话：956007

网址：www.jhzq.com.cn

(48) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址：广东省深圳市福田区金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

法定代表人：张巍

客服电话：95514 或 400-6666-888

网址：www.cgws.com

(49) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼（陆家嘴商务广场）

法定代表人：祝健

客服电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

(50) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：刘加海

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(51) 英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路 2068 号华能大厦东区 29、30、31 楼

办公地址：深圳市深南中路华能大厦 30 楼

法定代表人：郝京春

客服电话：4000-188-688

网址：www.ydzq.sgcc.com.cn

(52) 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招行上海大厦 18 层、19 层、29 层

法定代表人：黄金琳

客户热线：95547



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

(53) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉新华路 8 号

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

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

(54) 大通证券股份有限公司

注册地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层

办公地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层

法定代表人：赵玺

客户服务电话：4008-169-169

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

(55) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

客服电话：95321

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

(56) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号文化大厦 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：祁建邦

客户服务电话：95368 或 400-689-8888

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

(57) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570（当地未有分支机构的省市优先拨打 4008885288）

公司网址：www.glsc.com.cn

(58) 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

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 5 层

法定代表人：胡伏云

客户热线：95548

网址：www.gzs.com.cn

(59) 五矿证券有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 48 楼

法定代表人：黄海洲

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

(60) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层

法定代表人：吴小静

客服电话：95329

网址：www.zszq.com.cn

(61) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

客服电话：95532

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

(62) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 层

法定代表人：李强

客服电话：4008323000

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

(63) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州市工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：95330

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

(64) 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 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

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

(65) 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：深圳市罗湖区梨园路 Halo 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.jjmmw.com

(66) 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：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：王珺

客服电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

(67) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

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：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(68) 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 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：95021/4001818188

网址：www.1234567.com.cn

(69) 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：章知方

客服电话：400-920-0022

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

(70) 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 号国金中心二期 4609-4610 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 层

法定代表人：张峰

客服电话：400-021-8850

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

(71) 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：[lt.toutou.com.cn](http://lt.toutou.com.cn)

(72) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-032-5885

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

(73) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 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.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

(74) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

客服电话：400-898-0618

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

(75) 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：上海市徐汇区桂箐路 69 号 24 幢 4 楼

法定代表人：金佶

客服电话：400-820-2819

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

(76) 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：深圳市福田区金田路 1088 号中洲大厦 32 层 03A

法定代表人：祝中村

客服电话：0755-83999907

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

(77) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

客服电话：400-618-0707

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

(78) 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：陈祎彬

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

(79) 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 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号 4 层 407

法定代表人：罗细安

客服电话：010-67000988

网址：www.zcvc.com.cn

(80) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 B 座 1108

法定代表人：王利刚

客服电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

(81) 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 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-6533-789

网址：www.xds.com.cn

(82) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#(仅限办公)

办公地址：深圳市福田区福田街道 民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：洪泓

客服电话：400-116-1188

网址：www.new-rand.cn

(83) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦

法定代表人：冉云

客户热线：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(84) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 幢 23 层 1 号、4 号

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

(85) 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：中国(上海)浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：宋晓言

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

(86) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：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



(87) 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

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客服电话：400-817-5666

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

(88) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座

法定代表人：邹保威

客服电话：400 098 8511

网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

(89) 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：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人：戴晓云

客服电话：010-59013895

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

(90) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：广州海珠区琶洲大道东保利国际广场南塔 1201 楼盈米基金

办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

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

(91) 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(上海泰和经济展发区)

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：www.jiyufund.com.cn

(92) 济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 3 层 307 单元

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(93) 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第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

法定代表人：杨志涌

客服电话：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

(94) 财咨道信息技术有限公司

注册地址：沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号

办公地址：沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号

法定代表人：朱荣晖

客服电话：024-82280606

网址：www.caizidao.com.cn

(95) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

办公地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号东航滨江中心 1 号楼 1203 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

网址：www.zhongzhengfund.com

(96) 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

(97) 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

客服电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

(98) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 17 层 19C13

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场 T2 座 19 层

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.cn

(99) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 5 层 01、02、03 室

办公地址：上海浦东陆家嘴金融世纪广场 3 号楼 5F

法定代表人：吕柳霞

客服电话：021-50810673

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

(100) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：吴强

客服电话：952555

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

(101) 通华财富(上海)基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 楼

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

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

(102) 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 503

法定代表人：温丽燕

客服电话：4000-555-671

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

(103) 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：4008909998

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

(104) 中信期货有限公司

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 13 层 1301-1305、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

客服电话：400-990-8826

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

(105) 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：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

法定代表人：李科

客服电话：95510

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

(106) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客服电话：400-159-9288

网址：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

(107) 上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

办公地址：上海市浦东新区民生路 1299 号丁香国际大厦西塔 19 层 02/03 室

法定代表人：马金

客服电话：021-60608989

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

(108) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：盛超

客服电话：95055-4

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

(109) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

客服电话：010-66154828

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

(110) 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：成都市金牛区西宸龙湖国际 B 座 12 楼

法定代表人：于海锋

客服电话：400-080-3388

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

(111) 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

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)

(112) 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

(113) 甬兴证券有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

办公地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

法定代表人：李抱

客服电话：400-916-0666

网址：www.yongxingsec.com

(114) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：杨玉成

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.sywg.com

## (二) 注册登记机构

名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

法定代表人：万众

总经理：高宇

成立日期：2003年5月23日

电话：021-20899188

传真：021-20899057

联系人：唐叶丹

网址：www.ftfund.com

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所  
地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室  
负责人：廖海  
电话：（021）51150298  
传真：（021）51150398  
经办律师：梁丽金、刘佳

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：上海市黄浦区延安东路222号30楼  
办公地址：上海市黄浦区延安东路222号30楼  
法定代表人：付建超  
联系人：潘俊峰  
联系电话：（0755）3637 6906  
经办注册会计师：汪润松、潘俊峰

## 六、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构。投资者可以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的申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对



前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

## 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金于 2011 年 7 月 4 日起开始办理申购、赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可根据基金运作的实际情况依法更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前按规定在规定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

#### 2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

#### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

## （五）申购与赎回的数额限制

### 1、申请申购基金的金额

通过代销机构申购本基金，单个基金账户单笔最低申购金额为 1000 元（含申购费）；通过直销中心柜台申购本基金，单个基金账户单笔首次申购最低金额为 5 万元（含申购费），追加申购最低金额为 1 万元（含申购费），已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

通过本公司网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为 1000 元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

### 2、申请赎回基金的份额

投资人可将全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回的基金份额不得低于 100 份。

3、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的单只基金余额不足 100 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余份额一次性全部赎回。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规或监管机构另有规定或基金合同另有约定的除外。

5、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，具体请参见更新招募说明书或相关公告。

6、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须按规定在规定媒介上公告。

## （六）申购费与赎回费

### 1、申购费

本基金的申购费用按照《销售费用管理规定》收取，本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。在申购时收取的申购费称为前端申购费。费率按申购金额递减，申购费率具体如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M<50 万	1.20%
50 万≤M<200 万	0.80%
200 万≤M<500 万	0.40%
M≥500 万	每笔 1000 元

## 2、赎回费

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率具体如下表所示：

连续持有期限 (日历日)	赎回费率
7 天以下	1.5%
7 天 (含 7 天) ~ 1 年以下	0.50%
1 年 (含 1 年) ~ 2 年	0.25%
2 年以上 (含 2 年)	0.00%

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对其他投资者收取的赎回费中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率和赎回费率或收费方式。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前按规定在中国证监会规定媒介上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求，履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率，并在调整实施 2 日前在中国证监会规定媒介上刊登公告。

## (七) 申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算方式

基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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

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

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

例如：某投资者投资 10 万元申购本基金，所对应的申购费率为 1.20%。并假定当日的基金份额净值为 1.062 元。则申购份额为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率}) = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金单位净值} = 98,814.23 / 1.062 = 93,045.41 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10 万元申购本基金，假定当日的基金份额净值为 1.062 元，则可得到 93,045.41 份。

## 2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”，赎回总额为按照实际确认有效的赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

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

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

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

例如：某投资者赎回 1 万份基金份额，持有期大于 7 天小于 1 年，假设赎回当日基金份额净值是 1.062 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值} = 10,000 \times 1.062 = 10,620 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率} = 10,620 \times 0.5\% = 53.10 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,620 - 53.10 = 10,566.90 \text{ 元}$$

即：投资者赎回基金份额 1 万份，假设赎回当日基金份额净值是 1.062 元，则其可得到的赎回金额为 10,566.90 元。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同约定公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

5、申购费用由投资人承担，并应在投资人申购基金份额时收取，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。

6、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对其他投资者所收取赎回费中不低于赎回费总额的 25% 应归入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

## （八）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按规定在规定媒介上公告。

## （九）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或无法受理投资者的申购申请。
- 2、证券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。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
- 7、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的某笔或数笔申购。
- 8、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。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 6 项暂停申购情形，基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当在规定媒介刊登暂停申购公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

## （十）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无法支付赎回款项。

2、证券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。

3、基金连续发生巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况。

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，已接收的赎回申请可延期支付，但延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在规定媒介上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在规定媒介上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金财产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

(3) 当发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20% 以上的情形时，基金管理人可以对该基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请进行延期办理，对于当日未延期办理的赎回申请，基金管理人根据上述（1）或（2）处理。当日未获受理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；如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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

(5) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上公告。

## **（十二）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，并在规定期限内在规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，在规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、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定，在规定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## **七、基金的转换、非交易过户及转托管**

### **（一）基金转换**

为满足广大投资者的理财需求，本公司已经通过销售机构开办了本基金和本公司管理的其他开放式基金之间的相互转换业务。具体规则和办理范围详见各代销机构或本基金管理人发布的相关公告。投资者需到同时代理拟转出和转入基金的同一销售机构办理基金的转换业务，具体以销售机构

规定为准。

## （二）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，或者按照相关法律法规或国家有权机关另有要求的方式进行处理的行为。基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

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、法人或其他组织或者以其他方式处分。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## （三）基金的转托管

基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

## （四）定期定额投资计划

本基金已通过销售机构开办定期定额投资业务。具体规则和办理范围详见各代销机构或本基金管理人发布的相关公告。本基金开通定投业务的每期最低申购金额为 100 元（含申购费），各代销机构可以根据自己的业务情况设置高于或等于本公司设定的上述最低定期定额申购金额，投资人在销售机构办理上述基金定期定额投资业务时，除需满足本公司上述最低定期定额申购金额限制外，还需遵循相关销售机构的规定。

## （五）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。



## 八、基金的投资

### （一）投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

### （二）投资理念

中国经济持续稳定的发展为中国资本市场尤其是证券市场的发展奠定了坚实的基础，而指数化投资以低成本和较低的风险而获取市场的长期平均回报。中证 200 指数具有良好的市场代表性，并兼具成长性和流动性。本基金以复制和跟踪中证 200 指数为原则，通过买入并持有的长期化投资策略，为投资者提供一个低成本的投资工具，分享中国经济增长带来的中长期收益。

### （三）投资范围

投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

### （四）标的指数

本基金的标的指数为中证 200 指数。

未来若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，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。

## （五）中证 200 指数及其编制方法

### 1、指数简介

为反映市场上不同规模特征股票的整体表现，中证指数有限公司以沪深 300 指数为基础，构建了包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系，为市场提供丰富的分析工具和业绩基准，为指数产品和其他指数的研究开发奠定基础。

其中，反映中盘特征的指数为中证中盘 200 指数（CSI Midcap 200 index），简称中证 200（CSI 200），上海行情代码为 000904，深圳行情代码为 399904。指数基期为 2004 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

### 2、指数编制方法

沪深 300 指数成份股中非中证 100 指数样本股的 200 家公司股票构成中证 200 指数样本股。其选样空间为：

（1）上市交易时间超过一个季度，除非该股票自上市以来的日均 A 股总市值在全部沪深 A 股中排在前 30 位；

（2）非 ST、\*ST、非暂停上市股票；

（3）公司经营状况良好，最近一年无重大违法违规事件、财务报告无重大问题；

（4）股票价格无明显的异常波动或市场操纵；

（5）剔除其它经专家委员会认定不能进入指数的股票。

中证 200 指数以调整股本为权重，采用派许加权综合价格指数公式进行计算。其中，调整股本根据分级靠档方法获得。当沪深 300、中证 100、中证 500 指数调整样本股时，中证 200 随之进行相应的调整。

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，网址：

[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

## （六）投资策略

本基金主要采用完全复制法，按照在中证 200 指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合和跟踪中证 200 的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

为控制基金偏离业绩比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日跟踪误差不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人

可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓期为 6 个月，6 个月后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

### 1、资产配置策略

本基金采用两层次的自上而下资产配置策略，首先确定基金资产在权益资产与固定收益及现金资产间的配置比例，再按照中证 200 指数成份股的权重确定个股的配置比例。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于中证 200 指数成份股及备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

### 2、股票投资策略

#### (1) 股票组合构建原则

本基金通过复制指数的方法，根据中证 200 指数成分股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 200 指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。

在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- 1) 法律法规的限制；
- 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高；
- 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- 5) 预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及  $\beta$  值相近等原则来选择替代股票。

#### (2) 股票组合调整方法

本基金所构建的股票投资组合原则上根据中证 200 指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增

发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 200 指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### 1) 定期调整

中证 200 指数委员会每隔半年召开审核会议，使用过去 12 个月的数据，根据指数编制方法，决定成份股审核结果（指数成份股及其权重）。本基金将根据基准指数的调整规则、备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法，以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

#### 2) 临时调整

A. 当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

B. 在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

C. 如果预期指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视情况对基金资产进行前瞻性的调整，以更好地跟踪基准指数。

D. 本基金将根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效地跟踪标的指数。

E. 如果因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得基金管理人无法依照基准指数权重购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取综合考虑基准指数成份股和替代股票主营业务的相似性、规模相似性以及历史收益率的相关性。

F. 针对我国证券市场新股发行制度的特点，在不违反相关法律法规的前提下，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

#### 3、债券投资策略

本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，综合运用利率预测模型和收益率曲线模型等工具，评定各品种的投资价值，同时着重考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。

#### 4、现金管理策略

现金管理是指数基金投资管理的一个重要环节，主要由三方面内容组成：现金流预测、现金持有比例管理以及现金资产收益管理。

#### 5、其他金融工具投资策略

本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的特征来估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

## （七）投资决策依据和决策程序

### 1、投资决策依据

- （1）国家有关法律、法规、基金合同等的相关规定。
- （2）国家宏观经济运行态势、微观经济运行环境和证券市场走势。
- （3）标的指数的编制方法及其变更。
- （4）研究部研究员在独立研究基础上组撰写的研究报告。

### 2、投资准备程序

基金经理及研究员依托基金管理人整体研究平台，整合外部研究机构的研究成果，开展指数跟踪、成份股及备选成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

### 3、投资决策程序

（1）基金管理人主要采用完全复制成份股及其权重的方法确定目标组合。基金经理小组根据中证 200 指数系列成份股名单及权重，结合对成份股流动性、公司行为、基本面、交易成本等因素的分析，确定合理的建仓策略。

（2）在日常管理中，基金经理和研究员跟踪标的指数成份股公司行为信息，如股本变化、分红、停牌、复牌，以及成份股公司其它重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而确定组合调整策略。

（3）基金经理根据实际交易情况、申购赎回情况、对跟踪误差的监控结果、风险管理部风险监控和绩效评估报告，采用相应的投资策略、优化方法对投资组合进行动态调整；

（4）基金经理在目标指数成份股定期调整信息公开前一个月内，根据对调整方案的分析预测以及成份股调整对股价影响的分析，决定采取提前调整还是事后调整的策略，增持可能进入目标指数的股票，剔除可能被调整出目标指数的股票，并向投资决策委员会提交报告，经投资决策委员会批准后方可进行；

（5）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；

(6) 投资决策委员会通过月度、季度、年度会议和不定期会议对基金配置的组合方案进行审议和确定。

#### 4、投资执行程序

交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

#### 5、投资评估程序

(1) 风险管理部对投资组合进行跟踪评估，提出风险控制意见，按照风险大小，定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会报告。

(2) 评估和调整决策程序：投资决策委员会根据环境的变化和实际需要可以调整决策的程序，基金经理调整投资组合应按授权权限和批准程序进行。

风险管理部的基金评估报告主要包括两大部分，即基金绩效归因报告和基金风险评估报告。

### (八) 投资限制

#### 1、投资比例限制

(1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%；

(2) 本基金投资于中证 200 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；

(3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

(4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(5) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；

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

(7) 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%；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%；

(8) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(10) 法律法规或监管部门规定的其他投融资比例限制。

除上述第(6)、(8)、(9)项外，因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

本基金应在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。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。

## 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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## (九) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

由于本基金的投资标的为中证 200 指数，且本基金现金以及到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%（现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），因此本基金将业绩比较基准定为中证 200 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

未来若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，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。

### **（十）风险收益特征**

本基金为指数型基金，具有较高风险和较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度地分散掉非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

### **（十一）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法**

本基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则和方法如下：

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，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。

### **（十二）基金的融资融券**

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。



### （十三）基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同的规定，已复核本投资组合报告的内容。

#### 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	14,406,390.58	92.03
	其中：股票	14,406,390.58	92.03
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	1,242,138.81	7.94
8	其他资产	5,021.95	0.03
9	合计	15,653,551.34	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 报告期末指数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	30,032.94	0.19
B	采矿业	301,137.74	1.94
C	制造业	9,570,261.94	61.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	301,984.57	1.95
E	建筑业	390,323.34	2.51
F	批发和零售业	262,250.43	1.69

G	交通运输、仓储和邮政业	316,449.11	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	788,954.16	5.08
J	金融业	1,617,451.69	10.42
K	房地产业	269,202.55	1.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	238,730.40	1.54
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	194,854.25	1.26
R	文化、体育和娱乐业	124,757.46	0.80
S	综合	-	-
	合计	14,406,390.58	92.79

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

## 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

## 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

### 3.1 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	002241	歌尔股份	4,517	244,369.70	1.57
2	002460	赣锋锂业	1,587	226,702.95	1.46
3	002466	天齐锂业	2,000	214,000.00	1.38
4	688981	中芯国际	3,700	196,063.00	1.26
5	603799	华友钴业	1,737	191,608.47	1.23
6	603986	兆易创新	1,076	189,214.60	1.22
7	002049	紫光国微	838	188,550.00	1.21
8	600111	北方稀土	4,101	187,825.80	1.21
9	002230	科大讯飞	3,511	184,362.61	1.19
10	002271	东方雨虹	3,485	183,589.80	1.18

### 3.2 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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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

报告期末本基金未投资贵金属。

### 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

本报告期末本基金未持有权证。

### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

#### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

### 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

### 11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,704.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	116.17
5	应收申购款	3,200.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,021.95

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 11.5.2 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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

**11.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。**

## 九、基金的业绩

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

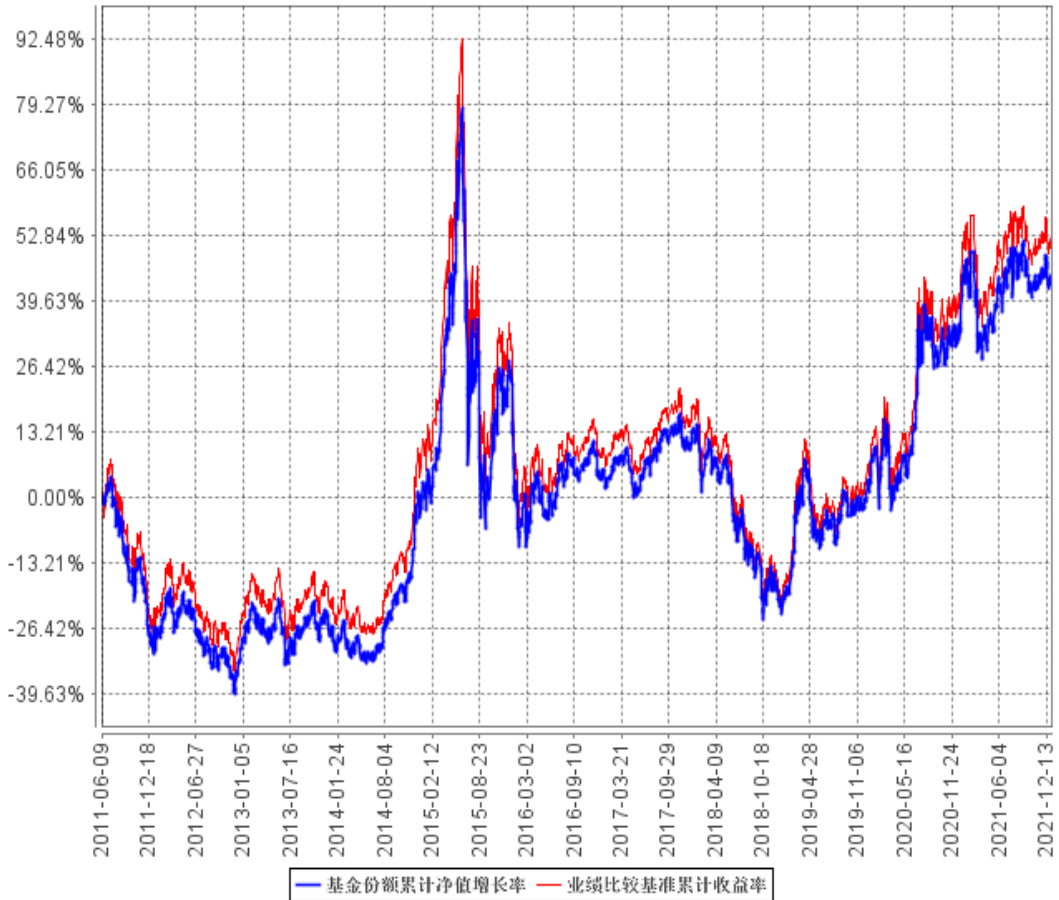
（一）基金合同生效日为 2011 年 6 月 9 日。基金合同生效以来（截至 2021 年 12 月 31 日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
20210101-20211231	5.24%	1.17%	5.75%	1.18%	-0.51%	-0.01%
20200101-20201231	31.07%	1.53%	32.66%	1.55%	-1.59%	-0.02%
20190101-20191231	34.51%	1.28%	35.38%	1.31%	0.87%	0.03%
20180101-20181231	-29.41%	1.34%	-30.47%	1.37%	1.06%	-0.03%
20170101-20171231	6.77%	0.71%	6.84%	0.72%	-0.07%	-0.01%
20160101-20161231	-15.51%	1.65%	-16.43%	1.64%	0.92%	0.01%
20150101-20151231	23.44%	2.76%	19.69%	2.67%	3.75%	0.09%
20140101-20141231	34.76%	1.11%	35.78%	1.12%	-1.02%	-0.01%
20130101-20131231	3.57%	1.34%	3.88%	1.34%	-0.31%	0.00%
20120101-20121231	-0.71%	1.37%	1.48%	1.39%	-2.19%	-0.02%
20110609-20111231	-28.10%	1.30%	-24.37%	1.39%	-3.73%	-0.09%
20110609-20211231	45.33%	1.50%	52.76%	1.50%	-7.43%	0.00%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，及与同期业绩比较基准的变动进行比较：

(2011 年 6 月 9 日至 2021 年 12 月 31 日)

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：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满，基金投资组合各项比例符合基金合同的约定：股票资产占基金资产 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 十、基金的财产

### (一) 基金资产总值

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

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （四）基金财产的保管与处分

- 1、本基金的基金资产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销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。
- 4、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范围。
- 5、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值目的

本基金估值的目的是为了准确、真实地反映本基金所持有金融资产和所承担金融负债的公允价值，并准确计算出本基金的经营收益，为本基金的申购、赎回等交易提供公允的价值基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常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。

### （三）估值对象

本基金所持有的金融资产和所承担的金融负债。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，



可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(3) 有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

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

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

(5) 交易所以大宗交易方式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，按成本进行后续计量。

(6) 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。

3、权证估值

(1) 配股权证的估值

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

## (2) 认沽/认购权证的估值

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、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。

5、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。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

## (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 5、法律法规、中国证监会认定的其他情形。

## (七) 基金份额净值的计算和确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个交易日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算

结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

### （八）估值错误的处理

1、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三位以内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

2、当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，国家会计政策变更、市场规则变更等，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

3、如果法律、法规、规章及中国证监会另有规定的，从其规定。

## 十二、基金的收益分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额

每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

- 4、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；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **（四）收益分配方案**

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、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**

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后确定，基金管理人按法律法规的规定公告。

本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（六）收益分配中发生的费用**

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照基金管理人的相关业务规则执行。

## **十三、基金的费用与税收**

### **（一）基金费用的种类**

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7、基金的资金汇划费用和开户费用；
- 8、基金标的指数使用费；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 3、基金指数使用费

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的一次性费用，不列入基金费用；在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.02% 年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

I 为基金管理人与本基金的标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费年费率。

指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币伍万元，该下限超出正常指数使用基点费的部

分（即：每季指数许可使用基点费下限－该季指数许可使用基点费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用从基金财产中列支。

指数使用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次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

如果指数使用费的计算方法和费率等需要调整，本基金将在履行适当程序后变更本基金的指数使用费率或费率计算方法，基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在规定媒介进行公告。

### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### （四）基金管理费、基金托管费、指数使用费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在规定媒介上刊登公告。

如果指数使用费的计算方法和费率等需要调整，本基金将在履行适当程序后变更本基金的指数使用费率或费率计算方法。

基金管理人应在新的费率实施前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介进行公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期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）基金审计的有关事项

- 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从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其它规定事项进行审计。
- 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，须通知基金托管人。基金管理人应在更换会计师事务所后按规定公告。

## 十五、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）和《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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。

### （一）基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在规定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点。除此之外，基金招募说明书、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。

基金合同终止情形出现的，除基金合同另有约定外，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

## （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定报刊和网站上。

## （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在规定媒介和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （四）基金净值信息

1、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规定网站公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

2、在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、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，在规定网站公告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。

## （五）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）。

1、基金年度报告：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，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。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。

2、基金中期报告：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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

3、基金季度报告：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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监



会认定的特殊情形除外。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## （六）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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事件，包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 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、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过 50%；
- 11、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 30%；
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 13、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；
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；

- 19、基金更换基金注册登记机构；
- 20、基金开始办理申购、赎回；
- 21、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 22、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；
- 23、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 24、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 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它事项。

### （七）公开澄清

在基金合同期限内，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。

### （八）清算报告

基金合同终止情形出现的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

### （九）信息披露文件的存放与查阅

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

## 十六、风险揭示

基金业绩受证券市场价格波动的影响，投资人持有本基金可能盈利，也可能亏损。本基金主要投资于中证 200 指数成份股及其备选成份股等权益类金融工具，同时适度参与债券等固定收益类金融工具。

本基金面临的风险主要有以下方面：

### （一）市场风险

证券价格因受各种因素的影响而引起波动，将使本基金资产面临潜在的风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区政策等的变化会对证券市场产生一定的影响，从而导

致债券和股票市场的价格波动，影响基金收益，产生投资风险。

## 2、经济周期风险

随着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。基金投资于上市公司股票与债权，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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

## 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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，但不能完全避免。

## 5、购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

## 6、再投资风险

市场利率下降时，本基金以债券等固定收益类资产所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较低的收益率。再投资风险反映了利率下降对债券等固定收益类资产利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的风险互为消长。

## 7、国际竞争风险

随着对外开放程度的不断提高，我国上市公司在发展过程中必将面临来自国际市场上具有同类技术、提供同类产品的企业的激烈竞争，部分上市公司可能会由于这种竞争而导致业绩下滑，造成其股票价格下跌，从而影响本基金的收益水平。

## **(二) 管理风险**

虽然基金管理人在遵守基金合同和有关法律法规前提下，以应有的职业道德勤勉尽职地为投资人服务，但是仍可能因基金管理人的知识、经验、研究、管理、判断、决策、技能以及信息占有不全面和具体操作过程中可能产生的失误等因素影响本基金的收益水平。

## **(三) 流动性风险**

指基金资产不能迅速、低成本地转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的

风险。

1、在某些情况下如果基金持有的某些投资品种的流动性不佳、交易量不足，将会导致证券交易的执行难度提高，使得本基金在以指数权重为基础进行操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对股价产生比较大的影响，增加建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

2、本基金的运作方式为契约型开放式，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断波动。由于中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况。若由于基金投资人的连续大量赎回，导致本基金的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售证券，将会使基金资产净值受到不利影响。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金申购、赎回的具体安排请参见本招募说明书“六、基金份额的申购、赎回与转换”章节。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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（包括标的指数成份股及备选成份股、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和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。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金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以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取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、暂停基金估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依

照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### （四）本基金特有的风险

1、本基金为股票型基金，重点投资于中证 200 指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临中证 200 指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

##### 2、指数化投资风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，本基金面临基金净值和指数同步下跌的风险。

##### 3、投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

##### 4、跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

（1）基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等；

（2）基金发生申购或赎回：本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票、或在面临投资者赎回时无法将股票及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险；

（3）在指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度；

（4）当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

（5）基金参与新股申购、成份股派发现金股息、法律法规限制等其他可能导致跟踪误差的情形；

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

成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

#### 5、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 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%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。

#### 6、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，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。

#### 7、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) 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款项，由此基金管理人可能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。

### (五) 其他风险

1、因基金业务快速发展，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，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

2、在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、基金份额注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

4、金融市场危机、行业竞争、代销机构违约、托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

5、公司主要业务人员（如基金经理）的离职可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

6、由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金资产的损失。

7、其他意外导致的风险。

## 十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、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。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关的程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，而在 6 个月内无新的基金管理人、基金托管人承接的；

4、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；

5、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止情形发生后，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进

行清算。

## 2、基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

## 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

## 4、清算费用

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

## 5、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

## 6、基金财产清算的公告



基金财产清算公告于基金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组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十八、基金合同的内容摘要

### （一）基金管理人的权利和义务

#### 1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券

所产生的权利；

- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

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

- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

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

- (6) 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；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；

- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、中期和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

- (12) 计算并公告基金净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 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；
- (14) 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以保密，不得向他人泄露；

- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

(17) 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；

(18) 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；

(19) 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；

(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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人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托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

## **(二) 基金托管人的权利和义务**

### **1、基金托管人的权利**

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### **2、基金托管人的义务**

(1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；

(6) 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；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 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应予以保密，不得向他人泄露；

- (10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度、中期和年度基金报告的相关内容出具意见，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；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核基金管理人计算的基金财产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 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；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

### （三）基金份额持有人的权利和义务

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会**

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (8) 本基金与其他基金合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10) 法律法规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。

3、有以下情形之一的，经由管理人、托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会

- (1) 调低基金管理费率、基金托管费率；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (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；

(6) 按法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

#### 4、召集方式

(1) 除法律法规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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

(4) 代表基金份额 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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上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。

(5) 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) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在规定媒介上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点、方式；

(2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

(3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；

(4) 会务常设联系人姓名、电话；

(5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

(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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人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；

(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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

(4) 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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

① 议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

② 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

③ 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，

不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在本次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

④ 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

⑤ 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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### ① 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

### ② 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；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。



## 9、计票

### (1) 现场开会

① 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。重新清点后，大会持有人应当当场公布重新清点结果。

④ 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 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、基金托管人均有法律约束力。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定。

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在规定媒介上公告。

(4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## （五）基金合同的变更、终止与财产的清算

### 1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关的程序后，本基金合同应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- （3）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- （4）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；
- （5）法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 3、基金财产的清算

（1）基金合同终止情形发生后，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### （2）基金财产清算组

① 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

② 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

③ 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法

进行必要的民事活动。

(3) 清算程序

- ① 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ② 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③ 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④ 对基金财产进行评估和变现；
- ⑤ 制作清算报告；
- ⑥ 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；
- ⑦ 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- ⑧ 对基金财产进行分配。

(4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- ① 支付清算费用；
- ② 交纳所欠税款；
- ③ 清偿基金债务；
- ④ 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款①、②、③项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的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，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## (六) 争议的处理

- 1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
- 2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权

将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### （七）基金合同的存放及查阅方式

《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者可按工本费购买《基金合同》复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：泰信基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

法定代表人：万众

成立时间：2003 年 5 月 23 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】68 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

经营范围：基金设立、基金业务管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融

债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理（有效期至 2018 年 8 月 20 日）

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人对基金管理人之间的业务监督、核查

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

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的 90%。现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督：

- （1）本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%；
- （2）本基金投资于中证 200 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
- （3）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；
- （4）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券

回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(5) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；

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

(7) 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%；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%；

(8) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(9) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；本基金管理人承诺本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

(10) 法律法规或监管部门规定的其他投融资比例限制。

除上述第（6）、（8）、（9）项外，因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

本基金应在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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

3、对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

三) 基金托管人在上述第一)、二) 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

四) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

五) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

### **(三) 基金管理人**对**基金托管人**的业务**核查**

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

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未

执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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

#### **（四）基金财产的保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

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

##### **2、基金合同生效前募集资金的验资和入账**

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

（2）基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

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

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



外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### 4、基金进行存款投资的账户开设和管理

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

#### 5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

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

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

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

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

#### 6、债券托管专户的开设和管理

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

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，但要与非本基金的其他实物证券分开保管，保管凭证由基金托管人持有。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8、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，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。新账户按有关规则使用并管理。

(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。

## 9、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件。

## （五）基金资产净值计算和会计核算

### 1、基金资产净值的计算和复核

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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

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

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

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应向中国证监会报告；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损

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

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

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

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

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

### (2) 会计数据和财务指标的核对

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

### (3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点。除此之外，基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后三个月内予以公告，基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告，中期报告或者年度报

告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

## （六）基金份额持有人名册的保管

### 1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### 2、基金份额持有人名册的提供

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

### 3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管

理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费用给予补偿。

### （七）争议处理和适用法律

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

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

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 二十、对基金份额持有人的服务

本公司的投资者服务理念是“专业、效率、真诚、超越”。为保证旗下开放式基金的正常运营，为投资者提供安全、高效、方便的服务，本公司建立了完善的投资者服务系统，主要通过柜台、直销、电话、传真、网络等方式为投资人提供服务。

### （一）为投资者服务的种类

1、柜台服务

代销机构和本公司直销柜台将为投资者提供柜台服务。为方便直销投资者，本公司在上海建

立了直销柜台。具体内容包括：

类别	直销柜台	代销柜台
办理交易等业务	仅对直销投资者	仅对代销投资者
个人帐务查询	仅对直销投资者	仅对代销投资者
公共信息查询		所有投资者
问题解答	所有直销投资者	所有投资者
投诉		接受代销投资者投诉

## 2、Call Center服务

本公司的呼叫中心和各代销机构的Call Center共同为基金投资者提供投资者服务。本公司的呼叫中心设备完善，人工座席服务时间为工作日：8：45-11：45，13:00-17:00，并提供7\*24小时的自动语音服务，能够确保投资者的要求在3个工作日内得到答复。呼叫中心提供的服务如下：

类别	泰信基金的CALL-CENTER	代销机构的CALL-CENTER
个人帐务查询	所有投资者	代销投资者
交易确认短信	提供手机号码的投资者	
公共信息查询	所有投资者	所有投资者
问题查询	所有投资者	代销投资者
投诉	接受所有投资者投诉	接受代销投资者投诉

泰信基金的Call Center包括电话中心和人工坐席，功能如下：

功能	IVR（自动语音系统）	人工坐席服务系统
公共信息查询	公司简介 基金产品简介 基金费率 基金分红 基金经理信息	基金信息 公司信息 开放式基金业务常识解答 政策法规 每日NAV公告
投资者帐户查询	成交确认查询 投资者帐户信息查询 查询密码的修改	投资者帐户信息查询 投资者对帐单查询 投资者基本资料的修改 查询密码的修改
投诉	以人工坐席服务为主： 接入方式：普通电话接入 回复方式：传真、邮件、短信息、信函、电话 通过坐席与投资者的互动交流，受理、处理、回复投资者的投诉与建议	

## 3、公司网站

本公司的网站导航栏，包括泰信之窗、旗下基金、网上交易、活动专区、基金学院及客户服务等多个栏目，能够为投资者提供全面的信息服务。

功能	内容
公共信息查询	基金信息查询 公司信息

	开放式基金业务常识解答 每日NAV公告 公司重要公告 政策法规 宏观经济 热点分析
投资者帐户查询	成交确认查询 账户查询 查询密码的修改 投资者基本资料的查询
网上交易	基金认购（暂停服务） 基金申购（暂停服务） 基金定投（暂停服务） 基金转换（暂停服务） 基金赎回 交易查询 修改分红方式 个人资料修改
信息定制	短信服务 电子邮件服务

4、资料寄送

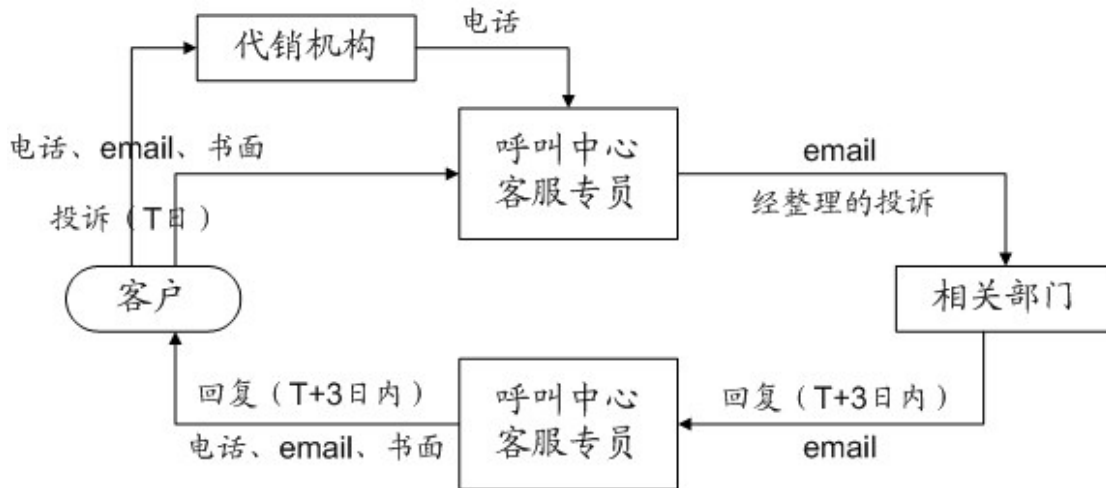
资料类型	投资者类型	寄送方式	寄送人
交易确认单	直销投资者	对有需求的直销柜台客户进行寄送	直销中心
基金帐户开户确认书	直销投资者	对有需求的直销柜台客户进行寄送	直销中心
交易对帐单	直销投资者 代销投资者	对有需求的客户，公司相应提供电子对账单和寄送纸质对账单	客服中心
公司产品其他投资理财咨询资料	直销投资者 代销投资者	对有需求的客户进行寄送	客服中心

5、一对一服务

公司除提供一般的投资者服务内容（包括电话查询、信息查询、资料寄送、基金经理报告会、资讯服务等）之外，还将以公司的整体资源为支撑，量身定制一对一的、个性化的增值服务，包括上门服务、充分的信息交流等，公司对机构投资者服务人员会进行专业知识的培训。

## （二）投诉人处理方式

本公司及时处理投资者的投诉，并在规定的时间内及时反馈。由于呼叫中心将成为投资者投诉的主要诉求对象，为了保证能及时处理投诉事宜，我们设置了完善的投诉处理流程，这是一个闭环流程，任何进入系统内的投诉必须在规定的时间内回复。同时我们将代销机构也纳入了这一系统，保证了我们向投资者提供统一专业的服务。



## （三）联络信息

### 1、泰信基金管理有限公司华东营销中心

地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36、37层

电话：（021）20899167

传真：（021）20899008

联系人：樊建华

### 2、泰信基金管理有限公司华北营销中心

地址：北京市西城区广成街4号院1号楼305、306室

电话：010-66215978

传真：010-66215968

联系人：费颖

### 3、泰信基金管理有限公司华南营销中心

地址：深圳市福田区福田街道口岸社区福田南路38号广银大厦18层C10

电话：0755-33988759

联系人：张宇

### 4、泰信基金管理有限公司网站



网址：www.ftfund.com

电子信箱：service@ftfund.com

### 5、客户服务中心

客户服务电话：400-888-5988 或 (021) 38784566，该电话为24小时语音服务电话，在工作时间内可转人工服务。

## 二十一、其他应披露事项

公告事项	法定披露方式	法定披露日期
关于旗下部分开放式基金在中国农业银行股份有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/02/26
在农业银行开通转换业务	《中国证券报》及规定网站	2021/02/26
招募说明书更新、产品资料概要更新	《中国证券报》及规定网站	2021/03/12
新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/03/25
关于旗下基金参与盈米基金转换费率优惠的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/03/25
2020 年年度报告	《中国证券报》及规定网站	2021/03/29
修改基金合同、招募说明书、产品资料概要	《中国证券报》及规定网站	2021/03/30
新增甬兴证券有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/04/01
关于调整部分销售渠道申赎、赎回下限公告	《中国证券报》及规定网站	2021/04/08
2021 年 1 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021/04/20
参与宁波银行股份有限公司同业基金销售平台的销售业务并开通转换、定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/05/26
部分基金在中航证券有限公司开通转换业务的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/07/09
新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠	《中国证券报》及规定网站	2021/07/12
关于新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并开通定投、转换及	《中国证券报》及规定网站	2021/07/16

费率优惠业务的公告		
2021 年 2 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2021/07/20
关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/07/22
关于旗下部分基金在招商证券股份有限公司开通定投并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/07/31
关于旗下部分基金参加基金销售机构费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/04
农业银行开通转换定投费率优惠	《中国证券报》及规定网站	2021/08/04
关于泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理变更的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/05
旗下部分基金在五矿证券开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/06
更新招募说明书、产品资料概要	《中国证券报》及规定网站	2021/08/10
关于旗下部分基金在华夏银行股份有限公司开通定投并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/25
关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/25
关于旗下部分基金在国信证券股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/25
2021 年中期报告		2021/08/28
关于旗下部分基金在兴业证券股份有限公司参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/08/31
旗下部分开放式基金新增度小满基金为销售机构, 开通转换、定投业务并参加其费率优惠活动	《中国证券报》及规定网站	2021/09/03
关于在上海天天基金销售有限公司调整首次申购、追加申购及定投起点的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/09/09
关于旗下部分基金在海通证券股份有限公司参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/09/09
关于新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/09/27
泰信基金管理有限公司关于股权变更的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/09/28
关于旗下部分基金参与新时代证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/10/15

2021 年第 3 季度报告		2021/10/26
在上海基煜基金销售有限公司调整申购、赎回业务起点及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/11/03
新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/12/08
在浙江同花顺基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司申购、定期定额投资、转换业务起点并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2021/12/09
参加国金证券申购费率优惠新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2022-01-07
关于旗下部分基金新增奕丰基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2022-01-11
"在上海华夏财富投资管理有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告"	《中国证券报》及规定网站	2022-01-17
2021 年第 4 季度报告	《中国证券报》及规定网站	2022-01-24
新增海银基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》及规定网站	2022-01-26

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书文本存放在本基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者也可直接登录本基金管理人的网站([www.ftfund.com](http://www.ftfund.com))查阅和下载招募说明书或其他法律文件。

## 二十三、备查文件

投资者如果需要了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或代销机构申请查阅以下文件：

- 1、中国证监会核准泰信中证 200 指数证券投资基金募集的文件
- 2、《泰信中证 200 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信中证 200 指数证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集泰信中证 200 指数证券投资基金之法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

泰信基金管理有限公司

2022 年 3 月 11 日