国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

招募说明书

（2024年6月第1次更新）

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）由国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金分级运作期届满转型而成。

《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》于2012年7月17日生效，并于2012年8月14日进入为期三年的分级运作期。在分级运作期内，瑞福优先份额自分级运作期开始后每满6个月开放一次，接受投资者的申购与赎回；瑞福进取份额在深圳证券交易所上市交易。国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金的三年分级运作期于2015年8月13日届满。

根据《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在分级运作三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）”。转换为上市开放式基金（LOF）时，瑞福优先份额资产将以现金形式给付，瑞福进取份额资产则转入国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）。转换为上市开放式基金（LOF）后，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、流动性风险、合规性风险、管理风险、操作风险及指数投资风险（包括跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险）、存托凭证投资风险等特定风险、其他风险等。

本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供

的评级结果为准。

本基金标的指数为深证 100 价格指数。指数编制方案请参见本招募说明书附件，指数信息详见国证指数网站，网址：www.cnindex.com.cn。

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪基准指数。本基金投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化、基金份额上市交易价格波动引致的投资风险，由投资者自行负担。

本招募说明书所载内容截止日期为2024年6月6日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2024年3月31日。有关财务数据未经审计。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司已对本招募说明书（2024 年 6 月第 1 次更新）进行了复核。

目 录

第一部分 绪言 1
第二部分 释义 2
第三部分 基金管理人 7
第四部分 基金托管人 19
第五部分 相关服务机构 24
第六部分 基金的历史沿革 57
第七部分 基金份额的交易 58
第八部分 基金份额的申购与赎回 60
第九部分 基金的投资 71
第十部分 基金的业绩 84
第十一部分 基金的财产 87
第十二部分 基金资产的估值 89
第十三部分 基金的收益分配 94
第十四部分 基金的费用与税收 96
第十五部分 基金的会计与审计 99
第十六部分 基金的信息披露 100
第十七部分 风险揭示 107
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 112
第十九部分 基金合同的内容摘要 115
第二十部分 基金托管协议的内容摘要 132
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 149
第二十二部分 其他应披露事项 151
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 152
第二十四部分 备查文件 153
附件一：标的指数编制方案 154

第一部分 绪言

《国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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“《流动性风险规定》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其他有关法律法规和《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的《基金合同》编写，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《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》。

第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

《基金合同》	指《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》及对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、部门规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《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
《流动性风险规定》	指《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
《上市规则》	指《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF），本基金由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作期届满转型而来；国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金自国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金（简称“瑞福分级基金”）转型而来
基金转型	指根据《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作 3 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）”。转换为上市开放式基

	金（LOF）后，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。
招募说明书或本招募说明书	指《国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
托管协议	指基金管理人与基金托管人签订的《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
基金产品资料概要	指《国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新（本基金基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
基金管理人	指国投瑞银基金管理有限公司（简称“国投瑞银”）
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司
基金份额持有人	指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
标的指数	指深证 100 价格指数
基金代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及基金代销机构
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
场外	指通过深圳证券交易所外的销售机构办理本基金基金份额的申购和赎回等业务的场所
场内	指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理本基金基金份额的申购、赎回、上市交易等业务的场所

注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指基金管理人或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
注册登记系统	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
上市交易所	指深圳证券交易所。
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
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	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的申购、赎回等业务的工作日
T 日	指办理基金业务的申请日
T+n	日指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
申购	指在本基金开放日内，基金投资者根据基金代销机构规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	指在本基金开放日内，基金投资者根据基金代销机构规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为
巨额赎回	指在单个开放日，经过申购与赎回申请的成交确认后，基金的净赎回金额超过本基金前一日基金资产净值的 10%时的情形
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有本基金基金份额情况的账户
交易账户	指用于记录投资者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同一基金账户（或股票账户）下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金收益	指基金投资所得的股票红利、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收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息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计算日基金份额总数
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
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
指定媒介	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（简称“指定报刊”）和/或指定互联网网站（简称“指定网站”，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）
不可抗力	指《基金合同》当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司

英文名称：UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD

住所：上海市虹口区杨树浦路 168 号 20 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 119 号安信金融大厦 18 楼

法定代表人：傅强

设立日期：2002 年 6 月 13 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：杨蔓

客服电话：400-880-6868、0755-83160000

传真：（0755）82904048

股权结构：

股东名称	持股比例
国投泰康信托有限公司	51%
瑞银集团	49%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

傅强先生，董事长，中国籍，工商管理硕士，现任国投泰康信托有限公司总经理，曾任国投信托有限公司公司总经理助理、公司副总经理，国投弘泰信托投资有限公司总经理

助理、信托资产运营部经理，国家开发投资公司金融投资部责任项目经理，国融资产管理有限公司高级项目经理、证券投资部副经理，中兴信托投资有限公司部门经理，北京证券有限公司职员，中国人民银行北京分行行员。

孙欣妍女士，董事，中国籍，会计学硕士。现任国投泰康信托有限公司财务副总监兼计划财务部负责人。曾任国投泰康信托有限公司计划财务部高级财务经理、计划财务部临时负责人、计划财务部总经理助理、计划财务部副总经理、计划财务部总经理，北京派克兰帝有限责任公司财务总监兼集团副总，中国医药集团总公司财务部高级主管，天职国际会计师事务所有限责任公司审计项目经理，北京铁道大厦有限责任公司财务会计。

王惠玲女士，董事，中国籍，经济学博士。现任瑞银环球资产管理(中国)有限公司总经理、瑞银资产管理中国主权及机构业务主管；曾任瑞银证券有限责任公司投资银行部私募融资部主管、董事总经理，资产管理部负责人、董事总经理，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司股权销售部及研究部主管、董事总经理，工银瑞信基金管理有限公司销售总监，天治基金管理有限公司总经理助理，泰信基金管理有限公司总经理助理，大通证券股份有限公司投资银行部副总经理，曾任职泰康人寿保险股份有限公司、劳动部社保所。

韦杰夫（Jeffrey R Williams）先生，董事，美国籍，哈佛大学商学院工商管理硕士。现任瑞士银行香港分行顾问、瑞银环球资产管理(中国)有限公司董事、瑞银慈善基金会董事，曾任汇添富基金管理股份有限公司独立董事，大瀚人力资源集团咨询董事会委员，哈佛中心（上海）有限公司董事总经理，深圳发展银行行长，渣打银行台湾分行行长，台湾美国国际运通股份有限公司总经理，美国运通银行台湾分行副总裁，花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长，花旗银行台湾分行信贷管理负责人，北京大学外国专家。

王彦杰先生，总经理，董事，中国台湾籍，台湾淡江大学财务金融硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事。曾任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监，宏利资产管理投资主管，复华投信香港资产管理有限公司执行长，保德信投信权益投资部投资主管，元大投信研究部股票分析师，日商大和证券研究部股票分析师，国际证券研究部股票分析师，国泰人寿理赔业务部理赔专员。

邓传洲先生，独立董事，中国籍，经济学博士。现任容诚会计师事务所上海分所管理合伙人。曾任职于致同会计师事务所、上海国家会计学院、北大未名生物工程集团公司、厦门国贸集团股份有限公司。

董纯钢先生，独立董事，中国籍，法学硕士，拥有中国和美国纽约州律师资格。现任

北京市竞天公诚律师事务所律师、合伙人，兼任香港国际仲裁中心理事会成员和委任委员会成员，中国商业法研究会常务理事，中国国际经济贸易仲裁委员会、北京仲裁委员会、深圳国际仲裁院等仲裁机构仲裁员。曾任中国国际经济贸易仲裁委员会案件经办人。

郝演苏先生，独立董事，中国籍，经济学学士。现任中央财经大学保险学院学术委员会主任、教授、博士生导师，兼任中国金融学会常务理事、中国计划生育委员会常务理事、全国保险专业学位研究生教育指导委员会常务副主任、教育部研究生案例专业委员会委员。曾任中央财经学院院长，也曾任职于香港中青风险管理有限公司、辽宁大学经济学院、台湾东吴大学客座教授等。还曾担任中国再保险集团公司独立董事、新华人寿保险公司独立董事、中国人民健康保险公司独立董事、鼎和财产保险公司独立董事等。

2、监事会成员

欧阳高文先生，监事会主席，中国籍，经济学硕士。现任国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部部门总经理。曾任国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部产品经理、高级产品经理、部门总监助理、部门副总经理，民生加银基金管理有限公司产品经理。

陈胜坤先生，监事，中国籍，管理学硕士。现任国投泰康信托有限公司投资管理总部总经理，历任国投泰康信托有限公司交易部二级业务助理、投资助理，信托财务部投资助理，资产管理总部助理研究员，投资管理总部投资经理助理、投资经理、高级投资经理、临时负责人、总经理助理、副总经理。

李拓先生，监事，中国香港籍，理学硕士。现任瑞银资产管理(香港)有限公司中国机构境外业务主管。曾任中国工商银行资产托管部全球托管处客户经理，工银亚洲托管部业务拓展主管，摩根基金（亚洲）有限公司高级客户顾问。

杨俊先生，监事，中国籍，经济学学士。现任国投瑞银基金管理有限公司交易部部门总经理。曾任大成基金管理有限公司高级交易员，国信证券有限责任公司投资部一级投资经理。

3、公司高级管理人员

王彦杰先生，总经理，董事，中国台湾籍，台湾淡江大学财务金融硕士。兼任国投瑞银资本管理有限公司董事。曾任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监，宏利资产管理投资主管，复华投信香港资产管理有限公司执行长，保德信投信权益投资部投资主管，元大投信研究部股票分析师，日商大和证券研究部股票分析师，国际证券研究部股票分析师，国泰人寿理赔业务部理赔专员。

靳赟女士，副总经理，中国籍，管理学学士。曾任国泰基金管理有限公司机构部董事总经理，东莞信托有限公司信托经理，北京电力华商伟业资产管理有限公司证券法律部部门经理，也曾任职于中国有色集团非洲矿业公司赞比亚谦比希公司。

汪斌先生，副总经理兼财务负责人，中国籍，东北财经大学金融学学士。兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长。曾任职国投泰康信托有限公司稽核审计部一级业务主管、部门副经理、部门总经理，安信信托股份有限公司稽核部部门经理、托管部部门经理、信托部部门副总经理、风险管理部部门总经理、信托业务部部门副经理，鞍山市信托投资股份有限公司综合计划部综合计划员、计划财务部部门经理助理、稽核部部门副经理、经理、财务会计部部门经理，鞍山市审计局财政金融审计处、综合外资审计处科员，副主任科员。

王明辉先生，督察长兼董秘，中国籍，南开大学经济学硕士。兼任国投瑞银资本管理有限公司董事，曾任国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部副总监、总监、监察稽核部及风险管理部部门总经理、公司总经理助理、首席风险官，国泰君安证券股份有限公司稽核审计总部审计总监。

刘艳梅女士，首席国际业务官，中国籍，复旦大学及香港大学工商管理（国际）硕士。兼任国际业务部部门总经理、上海分公司负责人，曾任国投瑞银基金管理有限公司国际业务部总监兼人力资源部总监、公司总经理助理兼国际业务部部门总经理兼国投瑞银资产管理（香港）有限公司总经理，华安基金管理有限公司监察稽核部副总监兼法务主管，天力投资顾问有限公司投资银行部项目经理，中国农业银行天津市分行信贷管理部法律顾问。

冯伟女士，首席运营官，中国籍，湖南大学（原湖南财经学院）经济学硕士。兼任运营部部门总经理、深圳分公司负责人，曾任国投瑞银基金管理有限公司运营部副总监、总监、公司总经理助理兼运营部部门总经理，中融基金管理有限公司运作保障部清算主管，深圳投资基金管理有限公司研究员，湖南省税务学校教师。

章国贤先生，首席信息官，中国籍，浙江工商大学经济信息管理专业本科学历。兼任信息技术部部门总经理，曾任国投瑞银基金管理有限公司开发工程师、副总监，深圳市脉山龙信息技术股份有限公司开发部经理，杭州恒生电子股份有限公司开发工程师、项目经理。

4、本基金基金经理

赵建先生，基金经理，量化投资部总监助理，中国籍，同济大学管理学博士。20 年证券从业经历。2003年8月至2010年6月历任上海数君投资有限公司（原上海博弘投资有限

公司）高级软件工程师、风控经理。2010 年 6 月加入国投瑞银基金管理有限公司，2013 年 4 月 2 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金的基金经理助理，2013 年 5 月 17 日至 2013 年 9 月 25 日担任国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2013 年 9 月 26 日起担任国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）（原国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金）基金经理，2015 年 2 月 10 日起兼任国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原国投瑞银沪深 300 金融地产指数基金）基金经理，2015 年 8 月 6 日起兼任国投瑞银白银期货证券投资基金（LOF）基金经理,2019 年 10 月 29 日起兼任国投瑞银沪深 300 金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 7 月 15 日起兼任国投瑞银专精特新量化选股混合型证券投资基金基金经理。曾于 2015 年 3 月 17 日至 2020 年 7 月 17 日期间担任国投瑞银瑞泽中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理，于 2019 年 10 月 29 日至 2020 年 9 月 18 日期间担任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 4 月 25 日至 2022 年 2 月 18 日期间任国投瑞银中证下游消费与服务产业指数证券投资基金（LOF）基金经理。

本基金历任基金经理：

芮颖女士，2007 年 07 月 17 日至 2008 年 05 月 30 日；

康晓云先生，2007 年 07 月 17 日至 2011 年 02 月 22 日；

朱红裕先生，2012 年 02 月 15 日至 2012 年 10 月 29 日；

黄顺祥先生，2009 年 11 月 03 日至 2012 年 10 月 29 日；

LU RONGQIANG 先生，2012 年 10 月 30 日至 2015 年 02 月 09 日。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

（1）投资决策委员会召集人：王彦杰先生，总经理

（2）投资决策委员会成员：

王建钦先生：公司总经理助理，投资副总监、资产配置部部门总经理

李达夫先生：固定收益部部门总经理，基金经理

桑俊先生：基金投资部部门总经理，基金经理

殷瑞飞先生：量化投资部部门副总经理，基金经理

杨俊先生：交易部部门总经理

焦洁女士：信用研究部部门副总经理

周宏成先生：资产配置部，基金经理

张弛先生：专户投资部部门副总经理

施成先生：研究部部门副总经理，基金经理

（3）总经理和督察长列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、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、按照基金合同及有关法律法规的规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、编制基金定期报告；

7、按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定提议召开和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、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

12、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；

13、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

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）不公平地对待本基金管理人管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律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）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密和尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（9）贬损同行，以抬高自己；

（10）以不正当手段谋求业务发展；

（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

五、基金经理承诺

1、维护基金份额持有人的利益。在基金份额持有人的利益与公司、股东及与股东有关联关系的机构和个人等的利益发生冲突时，坚持基金份额持有人利益优先的原则；

2、严格遵守法律、行政法规、中国证监会及基金合同的规定，执行行业自律规范和公司各项规章制度，不为了基金业绩排名等实施拉抬尾市、打压股价等损害证券市场秩序的行为，或者进行其他违反规定的操作；

3、独立、客观地履行职责，在作出投资建议或者进行投资活动时，不受他人干预，在授权范围内就投资、研究等事项作出客观、公正的独立判断；

4、严格遵守公司信息管理的有关规定以及聘用合同中的保密条款，不得利用未公开信息为自己或者他人谋取利益，不得违反有关规定向公司股东、与公司有业务联系的机构、公司其他部门和员工传递与投资活动有关的未公开信息；

5、不利用基金财产或利用管理基金财产之便向任何机构和个人进行利益输送，不从事或者配合他人从事损害基金份额持有人利益的活动。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险控制目标

（1）在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；

（2）确保国家有关法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；

（3）建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；

（4）将各种风险控制在合理的范围内，保障公司发展战略和经营目标的全面实施，维护基金份额持有人、公司及公司股东的合法权益；

（5）建立行之有效的风险控制系统，保障业务稳健运行，减轻或规避各种风险对公司发展战略和经营目标的干扰。

2、建立风险控制制度应遵循的原则

（1）最高性原则：风险控制作为基金管理公司的核心工作，代表着公司经营管理层对企业前途的承诺，公司经营管理层将始终把风险控制放在公司内部控制的首要地位并对此作出郑重承诺。

（2）及时性原则：风险控制制度的制订应当具有前瞻性，公司开办新的业务品种必须做到制度先行，在经营运作之前建章立制。

（3）定性与定量相结合的原则：形成一套比较完备的制度体系和量化指标体系，使风险控制工作更具科学性和可操作性。

3、风险控制体系

（1）风险控制制度体系

公司风险控制制度体系由五个不同层次的制度构成：第一个层次是公司章程；第二个层次是内部控制大纲；第三个层次是基本管理制度；第四个层次是部门管理制度；第五个层次是各项具体业务规则。

（2）风险控制组织体系

风险控制组织体系包括两个层次：

第一层次：公司董事会层面对公司经营管理过程中的各类风险进行预防和控制的组织，主要是通过董事会下设的合规风险控制委员会和督察长来实现的。它们在风险控制中的职责分别是：

①合规风险控制委员会的主要职责是：对公司经营管理和自有资产的运作的合法性、合规性进行检查和评估；对基金资产经营的合法性、合规性进行检查和评估；对公司内控机制、风险控制制度的有效性进行评价，提出建议方案提交董事会。

②督察长履行的职责包括对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核；就以上监察、稽核中发现的问题向公司经营管理层通报并提出整改和处理意见；定期向合规风险控制委员会提交工作报告；发现公司的违规行为，应立即向董事长和中国证监会报告。

第二层次：公司经营管理层设合规与风险控制委员会、法律合规部、风险管理部及各职能部门对经营风险的预防和控制。

①合规与风险控制委员会的主要职责是：评估公司内部控制制度的合法合规性、全面性、审慎性和适时性；评估公司合规与风险控制的状况；审议基金投资的风险评估与绩效分析报告；审议基金投资的重大关联方股票名单；评估公司业务授权方案；审议业务合作伙伴（如席位券商、交易对手、其他销售机构等）的风险预测报告；评估公司新产品、新业务、新市场营销渠道等的风险预测和合规评价报告；协调各相关部门制定突发性重大风险事件和违规事件的解决方案；界定重大风险事件和违规事件的责任；评估法规政策、市场环境等发生重大变化对公司产生的影响等。

合规与风险控制委员会下设业绩与风险评估小组，负责投资的业绩与风险分析评价，

并向合规与风险控制委员会提供相关报告。

②法律合规部的主要职责是组织和协调公司内部控制制度的编写、修订工作，确保公司内部控制制度合规、完善；检查公司内部控制制度和业务流程的执行情况，出具监察稽核报告；负责信息披露事务管理；调查基金及其他类型产品的异常投资和交易以及对违规行为的调查；负责公司的法律事务、合规咨询、合规培训等工作。

③风险管理部是履行风险管理职能的专门机构，在各业务部门合规与风险自我管理的基础上，自上而下建立公司层面风险管理体系，全面、细致地开展风险管理工作。风险管理部在风险控制中的职责包括对公司各类风险进行充分的揭示、对公司日常运营进行风险管理等。

④公司各职能部门的主要职责是对自身工作中潜在风险的自我检查和控制，各业务部门作为公司风险控制的具体实施单位，应在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定并严格执行。

4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

（1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司业务。股东会、董事会、监事会和经营管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行；公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度；建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性；建立投

资风险评估与管理制度，将重点投资限制在一定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（4）交易业务

建立交易部,实行集中交易制度，投资指令通过交易部完成；建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；建立科学的投资交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算；建立了会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整；设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布，加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定；加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进方法。

（7）监察稽核

公司设立督察长。督察长由董事会聘任或解聘，报中国证监会相关派出机构备案，并向董事会负责。督察长依据法律法规和公司章程的规定履行职责，可以列席公司任何相关会议，调阅公司任何相关制度、文件；要求被督察部门对所提出的问题提供有关材料和做出口头或书面说明；行使中国证监会赋予的其他报告权和监督权。

公司设立法律合规部，开展监察稽核工作，并保证法律合规部的独立性和权威性。公司明确了法律合规部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了监察稽核工作的专业任职条件、操作程序和组织纪律；法律合规部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行；公司董事会和经营管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究相关部门和人员的责任。

5、风险管理和内部控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员具有明确的内控分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动的独立进行，并得到高管人员的支持，同时，置备操作手册，并对其进行定期更新。

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

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

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了合规与风险控制委员会及其业绩与风险评估小组，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策。

（5）建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

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

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

6、基金管理人承诺上述关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善合规控制。

第四部分 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2024年3月，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄38岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2023年12月，中国工商银行共托管证券投资基金1404只。自2003年以来，中国工商银行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的97项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域

的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

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

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

4、内部风险控制措施实施

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

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

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

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

的。

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

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

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

5、资产托管部内部风险控制情况

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

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

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，

一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

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

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

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、场外销售机构

场外直销机构：

名称：国投瑞银基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华一路 119 号安信金融大厦 18 楼

法定代表人：傅强

电话：(0755)83575993 83575994

传真：0755-82904048

联系人：马征、李沫

客服电话：400-880-6868、0755-83160000

网址：www.ubssdic.com

场外代销机构：

（1）平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

电话：0755-82080387

传真：021-82080386

联系人：赵杨

客服电话：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

（2）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦

法定代表人：高迎欣

电话：010-58560975

传真：010-58560720

联系人：卿涛

客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

（3）中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

电话：010-66596688

传真：010-66016871

联系人：史辰方

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（4）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：廖林

电话：66108608

传真：010-66107571

联系人：吴于思

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（5）中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：张金良

电话：95580

传真：010-68858165

联系人：李红霞

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

（6）招商银行股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：缪建民

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：季平伟

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（7）兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

电话：0591-87824863

传真：0591-87842633

联系人：杨天明

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（8）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市黄浦区中山东一路12号

办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号

法定代表人：张为忠

电话：021-61618888

传真：021-63230807

联系人：吴雅婷

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（9）中国农业银行股份有限公司

住所：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

电话：010-85109619

传真：010-85126571

联系人：李紫钰

客服电话：95599

网址：www.abchina.com

（10）交通银行股份有限公司

住所：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

电话：021-58766688

传真：021-58798398

联系人：姜泱

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（11）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：张金良

电话：010-67597114

传真：010-66218888

联系人：卢子琦

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（12）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：宁波市鄞州区宁东路345号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-87050028

传真：0574-87050027

联系人：陈佳瑜

客服电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

（13）深圳前海微众银行股份有限公司

住所：深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座

法定代表人：顾敏

电话：95384

联系人：鲁文迪

客服电话：95384

网址：深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

（14）中信证券(山东)有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：肖海峰

电话：0532-85725062

传真：0532-85022301

联系人：赵如意

客服电话：95548

网址：http://sd.citics.com

（15）万联证券股份有限公司

住所：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13号高德置地广场E栋12层

法定代表人：王达

电话：020-38286588

传真：020-38286588

联系人：吕祥鉴

客服电话：95322

网址：www.wlzq.cn

（16）渤海证券股份有限公司

住所：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：天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座

法定代表人：安志勇

电话：022-28451991

传真：022-28451892

联系人：王星

客服电话：400-651-5988

网址：www.ewww.com.cn

（17）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：张伟

电话：025-83387793

传真：025-83387784

联系人：刘蓉

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（18）长城证券股份有限公司

住所：广东省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福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

法定代表人：张巍

电话：0755-83516072

传真：0755-83516244

联系人：王涛

客服电话：95514、400-6666-888

网址：www.cgws.com

（19）光大证券股份有限公司

住所：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

电话：021-22169999

传真：021-62151789

联系人：姚巍

客服电话：95525、4008888788

网址：www.ebscn.com

（20）海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

电话：021-23219000

传真：021-63410627

联系人：鲍清

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

（21）国投证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：段文务

电话：0755-82558305

传真：0755-81688000

联系人：彭洁联

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

（22）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：范力

电话：0512-62601555

传真：0512-62938812

联系人：陆晓

客服电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

（23）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 29 层

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 29 层

法定代表人：王怡里

电话：0351-8686668

传真：0351-8686667

联系人：王谷雨

客服电话：95573、400-666-1618

网址：www.sxzq.com

（24）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096806

传真：0431-85096816

联系人：安岩岩

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

（25）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

电话：010-63080906

传真：010-63080953

联系人：唐静、付婷

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

（26）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远国际中心 37 层(华远华中心 4、5 号楼 3701-3717)

法定代表人：施华

电话：0731-85832367

传真：0731-85832366

联系人：胡创

客服电话：95571

网址：www.foundersc.com

（27）东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：陈照星

电话：0769-22119350

传真：0769-22116999

联系人：陈士锐

客服电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

（28）中信证券华南股份有限公司

住所：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19层、20层

法定代表人：胡伏云

电话：020-88836999

传真：020-88836900

联系人：郭杏燕

客服电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

（29）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

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

电话：021-38631117

传真：0755-82400862

联系人：周驰、王婷婷

客服电话：95511-8

网址：www.stock.pingan.com

（30）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心29楼

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161691

传真：0551-65161600

联系人：孙懿

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

（31）上海证券有限责任公司

住所：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：何伟

电话：021-53686888

传真：021-53686100-7008

联系人：邵珍珍

客服电话：4008-918-918

网址：www.shzq.com

（32）国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：葛小波

电话：0510-82833209

传真：0510-82833124

联系人：郭逸斐

客服电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

（33）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

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：王晟

电话：010-86359022

传真：010-66568640

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888、95551

网址：www.chinastock.com.cn

（34）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：王洪

电话：0531-68889038

传真：0531-68889001

联系人：李明娟

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（35）华福证券有限责任公司

住所：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：上海市虹口区欧阳路218弄1号4层409室

法定代表人：苏军良

电话：021-20655183

传真：021-20655196

联系人：陈家旭

客服电话：95547

网址：www.hfzq.com.cn

（36）国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼

法定代表人：冉云

电话：028-86690021

传真：028-86695681

联系人：周一涵

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（37）爱建证券有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人：祝健

电话：021-32229888

传真：021-68728875

联系人：姚盛盛

客服电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

（38）粤开证券股份有限公司

住所：广东省广州市经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21,22,23层

办公地址：广东省广州市经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21,22,23层

法定代表人：严亦斌

电话：0755-83331195

传真：0752-2119660

联系人：彭莲

客服电话：95564

网址：www.ykzq.com

（39）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

联系人：周俊

客服电话：956007

网址：www.jhzq.com.cn

（40）申万宏源西部证券有限公司

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

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

电话：0991-2307105

传真：010-88085195

联系人：陈宇

客服电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

（41）华宝证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：上海市浦东新区世博大道 1859 号 1 号楼中国宝武大厦 7 楼

法定代表人：刘加海

电话：021-20657517

传真：021-68777992

联系人：闪雨晴

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（42）国盛证券有限责任公司

住所：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市凤凰中大道 1115 号

法定代表人：徐丽峰

电话：0791-86283372

传真：0791-86281305

联系人：占文驰

客服电话：956080

网址：www.gszq.com

（43）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

电话：010-84183203

传真：010-84183129

联系人：蓝天

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（44）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路268号

办公地址：福建省福州市湖东路268号

法定代表人：杨华辉

电话：0591-38507869

传真：0591-38281508

联系人：乔琳雪

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（45）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

电话：010-65608107

传真：010-65186399

联系人：许梦园

客服电话：4008888108

网址：www.csc108.com

（46）招商证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82944669

联系人：业清扬

客服电话：95565/0755-95565

网址：www.cmschina.com

（47）中国国际金融股份有限公司

住所：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层

法定代表人：沈如军

电话：010-65051166

传真：010-65051156

联系人：刘澜

客服电话：4009101166

网址：www.cicc.com.cn

（48）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦/北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：0755-23835383

传真：0755-23835861

联系人：杨柳

客服电话：95548

网址：www.citics.com

（49）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：王文卓

电话：0519-81595100

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531、400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

（50）世纪证券有限责任公司

住所：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：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40－42层

法定代表人：李剑峰

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：徐玲娟

客服电话：4008323000

网址：www.csco.com.cn

（51）第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦16-20楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-23838868

传真：0755-23838877

联系人：单晶

客服电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

（52）华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号19楼

法定代表人：祁建邦

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

联系人：谢彦虎

客服电话：95368

网址：www.hlzq.com

（53）中国中金财富证券有限公司

住所：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01-03、05、11-13、15、16、18-23单元

办公地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-820236907

传真：0755-82026539

联系人：陈梓基

客服电话：400-600-8008、95532

网址：www.ciccwm.com

（54）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：黄昊

电话：0991-2301870

传真：021-33388224

联系人：陈宇

客服电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

（55）财通证券股份有限公司

住所：浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼

办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼

法定代表人：章启诚

电话：0571-87821312

传真：0571-87823288

联系人：蔡还

客服电话：95336

网址：www.ctsec.com

（56）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967293

联系人：刘熠

客服电话：95323

网址：www.shchinafortune.com

（57）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号

法定代表人：贺青

电话：021-38676798

传真：021-38670798

联系人：钟伟镇

客服电话：95521、4008888666

网址：www.gtja.com

（58）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

电话：0755－82130833

传真：0755-82133952

联系人：于智勇

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（59）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦

法定代表人：何春梅

电话：0771-5539038

传真：0771-5530903

联系人：李健

客服电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

（60）东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

电话：021-23586603

传真：021-23586860

联系人：付佳

客服电话：95357

网址：www.eastmoney.com

（61）阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区景辉街 33 号院 1 号楼阳光金融中心

法定代表人：李科

电话：95510

传真：010-59053929

联系人：王超

客服电话：95510

网址：https://fund.sinosig.com/

（62）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：吴强

电话：952555

传真：0571-86800423

联系人：董一锋

客服电话：952555

网址：www.5ifund.com

（63）京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

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

法定代表人：邹保威

电话：95118

传真：010-89189566

联系人：薛晓奥

客服电话：95118

网址：fund.jd.com

（64）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

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

电话：400-032-5885

传真： 86-21-61101630

联系人：伍豪

客服电话：400-032-5885

网址：www.leadfund.com.cn

（65）通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦

法定代表人：沈丹义

电话：400-101-9301

传真：021-60810695

联系人：庄洁茹

客服电话： 400-101-9301

网址： www.tonghuafund.com

（66）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区田州路99号11号楼4楼

法定代表人：金佶

电话：021-34013999-3011

传真：021-34013999

联系人：甄宝林

客服电话：021-34013999

网址：www.hotjijin.com

（67）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505

法定代表人：林义相

电话：010-66045182

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客服电话：010-66045678

网址：http://jijin.txsec.com/

（68）上海天天基金销售有限公司

住所：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

电话：021-54509977

传真：021-64385308

联系人：王遂一

客服电话：95021

网址：www.1234567.com.cn

（69）腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海天二路33 号腾讯滨海大厦15楼

法定代表人：林海峰

电话：95017

传真：95017

联系人：谭广锋

客服电话：95017

网址：https://www.txfund.com/

（70）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

办公地址：北京市西城区西直门外大街甲一号环球财讯中心D座401

法定代表人：王伟刚

电话：010-62680527

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

（71）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-36696820

传真：021-68596919

联系人：鲁育铮

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（72）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号1503

法定代表人：王翔

电话：021-65370077

传真：021-58350979

联系人：张巍婧、骆晥

客服电话：400-820-5369

网址：https://www.jigoutong.com/

（73）上海长量基金销售有限公司

住所：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

电话：021-20691935

传真：021-20691861

联系人：刘畅

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（74）北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604 、607

办公地址：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604 、607

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601399

传真：010-59601399

联系人：宋晋荣

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

（75）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 09单元

办公地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦

法定代表人：陈祎彬

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：江怡

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（76）和讯信息科技有限公司

住所：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

电话：010-85657353

传真：010-65884788

联系人：陈慧慧

客服电话：400 920 0022

网址：http://licaike.hexun.com/

（77）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室

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层

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

联系人：邱湘湘

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（78）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层

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

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：龚江江

客服电话：4006-788-887

网址：www.jjmmw.com

（79）诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号长阳谷2号楼

法定代表人：汪静波

电话：021-80358523

传真：021-38509777

联系人：李娟

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

（80）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

电话：021-20292031

传真：021-20219923

联系人：张蜓

客服电话：021-20292031

网址：https://www.wg.com.cn/

（81）中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

联系人：梁美娜

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（82）上海联泰基金销售有限公司

住所：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号

法定代表人：尹彬彬

电话：021-52822063

传真：021-52975270

联系人：陈东、兰敏

客服电话：400-118-1188

网址：www.66liantai.com

（83）中信建投期货有限公司

住所：重庆市渝中区中山三路 131 号希尔顿商务中心 27 楼、30 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 490 号,世纪大道 1589 号 8 楼 10-11 单元

法定代表人：彭文德

电话：023-86769637

传真：023-86769629

联系人：王丹、李倩

客服电话：400-8877-780

网址：www.cfc108.com

（84）和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：温丽燕

电话：0371-85518396

传真：0371-85518397

联系人：高培

客服电话：4000555671

网址：www.hgccpb.com

（85）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号

法定代表人：王珺

电话：95188-8

传真：95188-8

联系人：韩爱彬

客服电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

（86）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

办公地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

法定代表人：才殿阳

电话：010-58664558

传真：010-58664558

联系人：魏晨

客服电话：4006099200

网址：http://www.yixinfund.com/

（87）北京雪球基金销售有限公司

住所：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号融新科技中心C座17层

法定代表人：李楠

电话：400-159-9288

传真：400-159-9288

联系人：田文晔

客服电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

（88）中国人寿保险股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街16号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：白涛

电话：010-63631752

传真：010-66222276

联系人：杨子彤

客服电话：95519

网址：www.e-chinalife.com

（89）泛华普益基金销售有限公司

住所：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 1201 号

法定代表人：于海锋

电话：020-28381666

传真：028-84252474-8055

联系人：史若芬

客服电话：400-080-3388

网址： https://www.puyifund.com/

（90）北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

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

电话：010-59403028

传真：010-59403027

联系人：林天赐

客服电话：95055-4

网址：www.duxiaomanfund.com

（91）北京创金启富基金销售有限公司

住所：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

电话：010-66154828

传真：010-63583991

联系人：魏素清

客服电话：010-66154828

网址：www.5irich.com

（92）博时财富基金销售有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

法定代表人：王德英

电话：0755-83169999

传真：0755-83195220

联系人：崔丹

客服电话：4006105568

网址：www.boserawealth.com

（93）上海中正达广基金销售有限公司

住所：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 1 号楼 1203、1204 室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：何源

客服电话：4006767523

网址：https://www.zhongzhengfund.com

（94）玄元保险代理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谙

电话：010-58732256

传真：021-50701053

联系人：姜帅伯

客服电话：400-080-8208

网址：https://www.licaimofang.cn/

（95）泰信财富基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206

办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206

法定代表人：彭浩

电话：4000048821

联系人：孙小梦

客服电话：4000048821

网址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206

（96）北京中植基金销售有限公司

住所：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：北京朝阳区大望路金地中心A座28层

法定代表人：武建华

电话：010-59313555

传真：010-56642623

联系人：丛瑞丰

客服电话：400-8180-888

网址：http://www.zzfund.com

（97）上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦

法定代表人：宋晓言

电话：021-50712782

传真：021-50712782

联系人：董怡芳

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

（98）嘉实财富管理有限公司

住所：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店 B 座（2#楼）27 楼 2714 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层

法定代表人：张峰

电话：010-65185678

传真： 010-65185678

联系人： 胡秋语

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

2、场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-50938782

传真：010-50938991

联系人：赵亦清

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市金杜律师事务所

住所：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

负责人：王玲

联系人：宋萍萍

电话：（010）58785588

传真：（010）58785599

经办律师：靳庆军、宋萍萍

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：沈俐

经办注册会计师：薛竞、沈俐

第六部分 基金的历史沿革

一、国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金转型

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）由国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作期届满转型而成。

《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 17 日生效，并于 2012 年 8 月 14 日进入为期三年的分级运作期。在分级运作期内，瑞福优先份额自分级运作期开始后每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回；瑞福进取份额在深圳证券交易所上市交易。国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金的三年分级运作期于 2015 年 8 月 13 日届满。

根据《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，在分级运作三年期届满，无需召开基金份额持有人大会，基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）”。转换为上市开放式基金（LOF）时，瑞福优先份额资产将以现金形式给付，瑞福进取份额资产则转入国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）。转换为上市开放式基金（LOF）后，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

二、国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金转型

国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金由国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金转型而成。

瑞福分级股票型证券投资基金获中国证监会证监基金字【2007】181 号文批准。发行总规模为 6,000,332,950 份基金份额，基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司，于 2007 年 7 月 17 日成立，基金存续期为 5 年。

2012 年 6 月 8 日，瑞福分级基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论并通过了《关于国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金合同延期及修改相关事项的议案》，经中国证监会《关于核准国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监许可[2012]880 号)文核准，基金份额持有人大会决议生效。依据基金份额持有人大会决议，瑞福分级基金延期并转型为“国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金”，基金运作方式转换为开放式基金，存续期调整为不定期。2012 年 7 月 17 日至 8 月 13 日为本基金的过渡期，自 2012 年 8 月 14 日起，本基金进入分级运作期，分级运作三年。

第七部分 基金份额的交易

本基金根据《基金合同》的约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）后，转换后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

一、上市交易的地点

深圳证券交易所。

二、上市交易的时间

本基金根据《基金合同》的约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）份额后，将自转换为上市开放式基金（LOF）之日起 30 日内继续在深圳证券交易所上市交易。

本基金自 2015 年 8 月 28 日起开始办理上市交易业务。

三、上市交易的规则

1、本基金上市首日的开盘参考价为其前一交易日的基金份额净值；

2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3、本基金的买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4、本基金的申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、本基金的上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

五、上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

六、上市交易的停复牌与暂停、终止上市

本基金的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

七、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

第八部分 基金份额的申购与赎回

投资者可通过场外或场内两个交易场所对基金份额进行申购与赎回。

（一）申购与赎回场所

基金份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构；基金份额场内申购与赎回的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

具体销售网点和会员单位的名单将由基金管理人在更新的招募说明书中列明。

基金投资者应当在上述销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

（二）申购与赎回的账户

投资者办理基金份额申购、赎回应使用经本基金注册登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜见相关业务公告）。

（三）申购与赎回的开放日及时间

基金份额的申购、赎回自国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作期结束后不超过 3 个月的时间内开始办理。

本基金自 2015 年 8 月 28 日起开始办理日常申购、赎回业务。

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。投资者在《基金合同》约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换的价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（四）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，基金份额的申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额的当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。基金管理人、基金登记结算机构或证券交易所另有规定的，从其规定；

4、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在申购与赎回的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购基金份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交基金份额的赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认时间

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

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

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T＋7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情

形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

（六）申购与赎回的数额限制

1、通过场外销售机构申购本基金的首次单笔申购最低金额为 1 元，追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元；在不低于上述规定的金额下限的前提下，如基金销售机构有不同规定，投资者在销售机构办理涉及上述业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

2、投资人场内申购的单笔申购最低金额为人民币 10 元（含申购费）。

3、场外基金份额持有人在销售机构赎回本基金的基金份额时，单笔最低赎回份额为 0.01 份，账户最低保留份额为 0 份。在不低于上述规定的基金份额下限的前提下，如基金销售机构有不同规定，投资者在销售机构办理涉及上述规则的业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

4、场内基金份额持有人在销售机构赎回本基金的基金份额时，每次赎回申请不得低于 10 份。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 10 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回；在不低于上述规定的基金份额下限的前提下，如基金销售机构有不同规定，投资者在销售机构办理涉及上述规则的业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

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。具体规定请参见《招募说明书》更新或相关公告；

6、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（七）申购费用和赎回费用

1、基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担；

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产。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；其他赎回费归入基金财产的比例为 80%。

3、基金份额的申购费用和赎回费用

（1）申购费用

本基金的场外前端申购费率如下表：

申购金额（M）	前端申购费率
M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	每笔 1，000 元

本基金的场外后端申购费率如下表：

持有时间（T）	后端申购费率
T<1 年	1.4%
1 年≤T<2 年	1.0%
2 年≤T<3 年	0.5%
T≥3 年	0

本基金的场内申购费率由基金代销机构比照场外前端申购费率执行。

（2）赎回费用

1）本基金的场外赎回费率如下表：

持有时间（T）	场外赎回费率
T<7 天	1.5%
7 天≤T<1 年	0.5%
1 年≤T<2 年	0.25%

T≥2 年	0

注：1 年按 365 天来计算。

2）本基金的场内赎回费率如下表：

持有时间（T）	场外赎回费率
T<7 日	1.5%
T≥7 日	0.5%

场内、场外投资人份额持有时间记录规则以登记结算机构最新业务规则为准，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。

（3）本基金的申购费用和赎回费用由基金申购人承担。申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用；赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金资产。

4、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

5、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，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的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相关手续后，基金管理人可以适当调低基金份额的申购费率和赎回费率。

（八）申购份额与赎回金额的计算

1、基金份额申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式。基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金场外申购时投资者可以选择支付前端申购费用或者后端申购费用。本基金场内申购时投资者仅能选择支付前端申购费用。

（1）若投资者选择支付前端申购费用，则申购份额的计算公式为：

申购费用=申购金额×申购费率/（1＋申购费率）

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额的基金份额净值

例 1：投资者通过场外投资 10，000 元申购本基金，前端申购费率为 1.2%，假定申购

当日本基金的基金份额净值为1.050元，则投资者可得到的申购份额为：

申购费用=10，000×1.20%/（1+1.20%）=118.58（元）

净申购金额=10，000－118.58 = 9881.42（元）

申购份额=9881.42/1.050=9410.88（份）

（2）若投资人选择支付后端申购费用，则申购份额的计算公式为：

申购份额＝申购金额/申购当日基金份额净值；

当投资人提出赎回时，后端申购费用的计算方式为：

后端申购费用＝赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

例 2：某投资人投资 10,000 元通过场外申购本基金，假定申购当日本基金的基金份额净值为1.050元，如果选择交纳后端申购费用，则其可得到的基金份额计算如下：

申购份额＝10,000/1.050＝9,523.81

2、基金份额赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日基金份额的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

（1）若投资者申购时选择支付前端申购费用，则赎回时净赎回金额的计算公式为：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额的基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例3：投资者赎回10，000份本基金，基金份额持有时间为6个月，赎回费率为0.5%，假定赎回当日本基金的基金份额净值为1.050元，则投资者可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10，000×1.050=10500（元）

赎回费用=10500×0.5%=52.5（元）

净赎回金额=10500-52.5=10447.5（元）

（2）若投资者申购时选择支付后端申购费用，则赎回时净赎回金额的计算公式为：

赎回总金额＝赎回份额×T日基金份额净值

后端申购费用＝赎回份额×申购当日份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额－后端申购费用－赎回费用

例4：假定某投资者通过场外申购本基金当日的基金份额净值为1.001元，该投资者选

择交纳后端申购费，并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回 10,000 份，赎回当日的基金份额净值分别为 1.025、1.080 和 1.140 元，各笔赎回扣除的赎回费用、后端申购费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回 1	赎回 2	赎回 3
赎回份额（A）	10,000	10,000	10,000
申购当日基金份额净值（G）	1.001	1.001	1.001
赎回当日基金份额净值（B）	1.025	1.080	1.140
赎回总金额（I）	10,250.00	10,800.00	11,400.00
适用的后端申购费率（F）	1.40%	1.00%	0.50%
后端申购费（H＝A×G×F）	140.14	100.10	50.05
适用的赎回费率(C)	0.50%	0.25%	0%
赎回费（E＝I×C）	51.25	27.00	0.00
净赎回金额（D＝I－H－E）	10,058.61	10,672.90	11,349.95

3、本基金基金份额净值的计算

T 日基金份额的份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额的基金份额净值为基准计算，其中，通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例 5：如例 1，投资者通过场外投资 10，000 元申购本基金，申购费率为 1.2%，假定申

购当日本基金的基金份额净值为 1.050 元，则投资者可得到的申购份额为 9410.88 份，申购费用为 118.58 元。

假如投资者选择通过场内申购的方式投资 10，000 元申购本基金，则因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9410 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者，计算方法如下：

实际净申购金额=9410×1.05=9880.5(元)

退款金额=10，000-9880.5-118.58=0.92(元)

5、赎回金额的处理方式：

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

（九）申购和赎回的注册登记

基金份额申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。场外申购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

通常情况下，投资者申购基金份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额；投资者赎回基金份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（十）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝基金投资者对基金份额的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

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

4、《基金合同》、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

5、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；

6、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

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

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

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，按规定公告。

（十一）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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

1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

2、证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；

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。

发生除上述第 5 项情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第 3 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长

不超过 20 个工作日，并在指定媒介公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金份额的赎回，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告。

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

（十二）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额的净赎回申请所对应的金额超过本基金前一日基金资产净值的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定赎回款项的全额支付或部分顺延支付。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回款项有困难或认为支付投资者的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大影响时，基金管理人按正常程序接受赎回金额不低于相当于该开放日前一日基金资产净值 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未获赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个工作日办理，赎回价格为按照赎回价格确认原则得到的下一个工作日的赎回价格。以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）当本基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一开放日基金总份额 30%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，可对该基金份额持有人的赎回申请超过前一开放日基金总份额 30%的部分进行延期办理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人赎回比例在前一开放日基金总份额 30%以内（含 30%）的赎回申请与其他投资者的赎

回申请一并按上述（1）、（2）方式处理。

（4）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》的有关规定通过指定媒介刊登公告，同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金的基金份额连续 2 个或 2 个以上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，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

（十三）重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介刊登基金份额重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日基金份额的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒介刊登基金份额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工作日基金份额的基金份额净值。

三、基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

五、基金份额的非交易过户、转托管、冻结与质押

本基金基金份额的非交易过户、转托管、冻结与质押等，按照中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司、深圳证券交易所等相关机构的规定办理。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证 100 价格指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

二、投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证，下同）、债券、权证、股指期货及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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

三、投资理念

中国经济将在较长时期内保持持续高增长，从而奠定了中国证券市场发展的宏观经济基础，进而为证券市场的指数化投资构筑了坚实的市场基础。本基金通过被动式、指数化的长期投资，力求获得标的指数所代表的股票市场平均收益率，以使投资者分享中国经济和中国资本市场中长期的成长收益。

四、投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。

当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因特殊情况（如股权分置改革等）导致基金无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差。

（1）类别资产配置

本基金采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在股票和其他资产之间的配置比例，然后通过指数复制的方法，确定各成份股的配置比例。

（2）股票组合构建与调整

1）股票组合构建

本基金采用指数复制构建股票组合中将使用以下模型

$$Vol_{i,t} = Weight_{i,t} \times Netvalue_{t} \div Price_{i,t}$$

上式中：

$Vol_{i,t}$ 为本基金对深证 100 指数中所有成份股在 t 时刻配置的股票数量；

$Weight_{i,t}$ 为深证 100 指数中第 i 个成份股 t 时刻在指数中所占的权重；

$Netvalue_t$ 为本基金在 t 时刻的股票配置总额；

$Price_{i,t}$ 为深证 100 指数中第 i 个成份股在 t 时刻的市场价格。

2）股票组合调整

根据基准指数成份股及其权重的变动、法律法规中的投资比例限制、增发新股等情形，对股票投资组合及时进行适度调整。

①基于基准指数成份股及其权重变动的调整

②成份股流动受限时的调整

③成份股基本面发生重大不利变化时的调整

为保护基金份额持有人利益，当某成份股基本面发生重大不利变化，预计将被剔除出成份股时，本基金将提前调降该成份股的配置权重，并用替代股票进行替代，也可根据指数编制规则前瞻性地预测入选股票来作为备选替代股票。

④一般情况下，本基金仅参与有望入选指数成份股的 IPO 新股申购以及成份股内增发新股的申购。但考虑到国内新股发行上市的市场特点，本基金也参与申购收益率较高的品

种，由此得到的非成份股将择机卖出。

⑤为有效控制基金的跟踪误差，在市场条件允许的情况下，本基金可能投资于金融衍生工具，以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

（3）股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。

本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

（4）存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

五、投资限制

（一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、向他人贷款或提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受

上述规定的限制。

（二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

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

3、本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的 90%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

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

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

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

6、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；

7、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

8、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，在履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

除上述第 4、5、6 项外，由于证券市场波动、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。

六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

95%×深证 100 价格指数收益率＋5%×银行活期存款利率（税后）。

深证 100 价格指数由深圳证券信息公司编制发布，其成份股由在深圳证券交易所上市、公司平均流通市值的比重和平均成交金额的比重排名在前 100 名的股票构成，对深圳 A 股市场有很强的代表性。

由于本基金的投资标的为深证 100 指数成份股及备选股，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×深证 100 价格指数收益率＋5%×银行活期存款利率（税后）。

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》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及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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。

七、风险收益特征

从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

八、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

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

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

九、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

十、投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2024 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	198,445,826.31	93.21
	其中：股票	198,445,826.31	93.21
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,430,660.63	6.78
7	其他各项资产	35,041.81	0.02
8	合计	212,911,528.75	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金不参与转融通证券出借业务。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	488,027.02	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,402.12	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	497,429.14	0.23

（2）指数投资按行业分类的股票投资组合

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	7,285,609.35	3.43
B	采矿业	880,296.00	0.41
C	制造业	153,556,361.77	72.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,066,776.00	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	823,360.00	0.39

G	交通运输、仓储和邮政业	3,251,380.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,164,087.88	2.90
J	金融业	16,298,065.25	7.67
K	房地产业	2,823,426.00	1.33
L	租赁和商务服务业	2,302,577.12	1.08
M	科学研究和技术服务业	1,565,065.80	0.74
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	1,931,392.00	0.91
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	197,948,397.17	93.13

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）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	300750	宁德时代	88,190.00	16,770,210.40	7.89
2	000333	美的集团	166,696.00	10,705,217.12	5.04
3	000858	五粮液	64,540.00	9,907,535.40	4.66
4	000651	格力电器	154,335.00	6,066,908.85	2.85
5	002594	比亚迪	29,832.00	6,057,685.92	2.85
6	300059	东方财富	446,349.00	5,753,438.61	2.71
7	300760	迈瑞医疗	18,300.00	5,150,718.00	2.42
8	002475	立讯精密	165,042.00	4,853,885.22	2.28
9	000568	泸州老窖	26,098.00	4,817,429.82	2.27
10	000725	京东方 A	1,093,176.00	4,438,294.56	2.09

（2）期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301536	星宸科技	3,699.00	150,759.18	0.07
2	301589	诺瓦星云	237.00	82,352.76	0.04
3	301587	中瑞股份	2,598.00	56,454.54	0.03
4	001359	平安电工	1,339.00	37,612.08	0.02
5	001389	广合科技	1,639.00	28,567.77	0.01

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末无股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用股指期货。

本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末无国债期货投资。

（3）本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，也未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选库的情况。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	729.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,293.45
6	其他应收款	18.57
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,041.81

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有处于流通受限的股票。

2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301589	诺瓦星云	82,352.76	0.04	新股锁定

2	301587	中瑞股份	56,454.54	0.03	新股未上市
3	001389	广合科技	28,567.77	0.01	新股未上市
4	301536	星宸科技	11,873.30	0.01	新股锁定
5	001359	平安电工	3,245.48	0.00	新股锁定

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十部分 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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表：

转型前：国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金

国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表（截止 2015 年 8 月 13 日）

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
2012．08．14（国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作起始日）至 2012.12.31	1.20%	1.37%	0.97%	1.36%	0.23%	0.01%
2013.01.01 至 2013.12.31	-4.38%	1.35%	-4.53%	1.35%	0.15%	0.00%
2014.01.01 至 2014.12.31	30.09%	1.15%	30.59%	1.15%	-0.50%	0.00%
2015.01.01 至 2015.8.13	24.17%	2.58%	26.52%	2.45%	-2.35%	0.13%

自国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金分级运作起始日至 2015.8.13	56.30%	1.63%	59.26%	1.58%	-2.96%	0.05%

注：1、由于本基金的投资标的为深证 100 指数成份股及备选股，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×深证 100 价格指数收益率＋5%×银行活期存款利率（税后）。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金的三年分级运作期于 2015 年 8 月 13 日届满，基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）”，基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序不变。

转型后：国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）

国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表（截止 2024 年 3 月 31 日）

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
2015.8.14 至 2015.12.31	1.95%	2.72%	-4.28%	2.49%	6.23%	0.23%
2016.1.1 至 2016.12.31	-13.58%	1.75%	-15.64%	1.57%	2.06%	0.18%
2017.1.1 至	21.10%	0.84%	25.02%	0.86%	-3.92%	-0.02%

2017.12.31						
2018.1.1 至 2018.12.31	-32.20%	1.48%	-33.15%	1.48%	0.95%	0.00%
2019.1.1 至 2019.12.31	53.77%	1.38%	52.03%	1.39%	1.74%	-0.01%
2020.01.01 至 2020.12.31	49.86%	1.56%	46.86%	1.57%	3.00%	-0.01%
2021.01.01 至 2021.12.31	1.58%	1.41%	-1.06%	1.42%	2.64%	-0.01%
2022.01.01 至 2022.12.31	-23.57%	1.41%	-24.89%	1.43%	1.32%	-0.02%
2023.01.01 至 2023.12.31	-14.60%	0.93%	-16.51%	0.94%	1.91%	-0.01%
2024.01.01 至 2024.03.31	0.37%	1.26%	0.51%	1.28%	-0.14%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	10.95%	1.46%	-6.03%	1.43%	16.98%	0.03%

注：1、由于本基金的投资标的为深证 100 指数成份股及备选股，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为 95%×深证 100 价格指数收益率＋5%×银行活期存款利率（税后）。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

第十一部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

1、银行存款及其应计利息；

2、清算备付金及其应计利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；

4、应收证券交易清算款；

5、股票投资及其估值调整；

6、债券投资及其估值调整和应计利息；

7、权证投资及其估值调整；

8、其他投资及其估值调整；

9、其他资产等。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人管理运作

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

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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十二部分 基金资产的估值

一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票，以其估值日证券交易所提供的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

已上市流通的权证，以其估值日证券交易所提供的收盘价估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值；

（2）首次公开发行的股票和未上市债券，按成本估值；

（3）处于未上市期间的权证或者不存在活跃市场的权证，例如权证发行至上市日之间、权证停牌日等情况，可应用 B-S 模型等估值技术确定其公允价值。

3、债券以及资产支持证券等固定收益品种的估值

（1）对在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的可转换债券采用交易所收盘价估值。

（2）上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（3）交易所的中小企业私募债、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。

（4）对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的债券，采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

（5）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。

（6）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。

（7）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。

4、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

5、基金持有的股指期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、在任何情况下，基金管理人如采用前述第 1-5 所列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。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

7、债券利息收入、存款利息收入、买入返售证券收入等固定收益的确认采用权责发生制原则。

8、股利收入的确认采用权责发生制原则。

9、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值信息。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

四、估值对象

基金所拥有的股票（含存托凭证）、债券、权证、股指期货等金融衍生品和银行存款本息等资产和负债。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后以双方认可的方式返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、基金份额净值的确认和估值错误的处理

本基金的基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过本基金的基金份额净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到本基金的基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向存在差错的责任人（“差错责任方”）追偿。

关于差错处理，《基金合同》的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或基金注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任方应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免并不能克服的，则按下列有关不可抗力的规定处理。

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

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方

应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

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

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

（6）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（5）基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

七、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、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，应当暂停基金估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

八、特殊情形的处理

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

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

第十三部分 基金的收益分配

一、基金收益的构成

基金收益包括：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收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

三、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。

四、基金收益分配原则

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、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；

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 6 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 20%；

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统中的基金份额，基金份额持有人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统中的基金份额只能采取现金分红方式，基金份额持有人不能选择红利再投资；

5、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；

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

五、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金净收益、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。

六、收益分配方案的确定、公告与实施

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

七、基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利归入基金财产。

第十四部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金标的指数使用费；

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

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

H＝E×管理费比例÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

H＝E×托管费比例÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本基金转型前的分级运作期起始日起开始计提，每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二，按季支付，自转型前的分级运作期起始日所在季度的下一季度起，指数使用费收取下限为每季度人民币 5 万元，即若不足人民币 5 万元则按照人民币 5 万元收取。

指数使用费的计算方法如下：

H=E×0.02%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从本基金转型前的分级运作期起始日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费每日计提，逐日累计，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，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指数所有人。

在基金存续期内，如果基金管理人与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议中关于“指数使用费”的内容有所修改的，将按照最新的内容进行费用计提和支付，此事无须召开份额持有人大会。

4、上述一、基金费用的种类中第 4－8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披

露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

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

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

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

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十五部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计；

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

第十六部分 基金的信息披露

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

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

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

基金产品资料概要编制、披露与更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

上述重大变更主要包括：

（1）基金合同、基金托管协议相关内容发生变更；

（2）变更基金简称（含场内简称）、基金代码（含场内代码）；

（3）变更基金管理人、基金托管人的法定名称；

（4）变更基金经理；

（5）变更认购费、申购费、赎回费等费率；

（6）其他对投资者有重大影响的事项。

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

（四）基金净值信息

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当通过指定网站、上市的证券交易所、基金销售机构网站或营业网点，在每个交易日的次日披露基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（五）基金份额申购、赎回价格

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

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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本基

金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

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

14、基金收益分配事项；

15、基金管理费、基金托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计算错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、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；

22、基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的

价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

（十）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算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，并由律师事务所出具法律意见书。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（十一）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

基金应当公开披露的信息包括定期报告和临时报告，信息披露义务人披露信息前，应当在第一时间将公告文稿和相关备查文件报送基金份额上市的证券交易所。

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息，基金销售机构应当按照中国证监会规定做好相关信息传递工作。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量，该费用不得从基金财产中列支。

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

第十七部分 风险揭示

一、投资组合的风险

基金的证券投资组合所面临的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

1、市场风险

证券价格受各种因素的影响而波动，从而可能给基金资产带来潜在的损失风险。影响证券价格波动的因素包括但不限于以下几种：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化可能导致证券市场的价格波动，影响基金收益。

（2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受宏观经济运行的影响，证券市场也呈现周期性变化特征。本基金主要投资于股票与债券，其收益水平也会随之发生变化。

（3）利率风险

金融市场的利率波动直接影响企业的融资成本和利润水平，并会影响股票市场和债券市场的走势变化，从而影响基金投资的收益水平。

（4）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

（5）上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响，上市公司经营不善可能导致股票价格的下跌，降低基金投资的收益水平。虽然本基金力求通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

（6）再投资风险

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

2、信用风险

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

交割风险。

3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括由于本基金出现巨额赎回，致使本基金没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

（1）基金申购、赎回安排

在申购、赎回安排方面，本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。此外，当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购申请、赎回申请或延缓支付赎回款项。投资人应注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第八部分、基金份额的申购与赎回”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。本基金属于跟踪深证 100 价格指数的开放式指数证券投资基金，其投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%。本基金的标的指数为深证 100 价格指数，其成份股由在深圳证券交易所上市、公司平均流通市值的比重和平均成交金额的比重排名在前 100 名的股票构成，对深圳 A 股市场有很强的代表性，其整体流动性处于较高的水平，因此在正常市场环境下本基金的流动性风险较低。

（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。

二、合规性风险

合规性风险是指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和《基金合同》的要求而带来的风险。

三、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不完全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

四、操作风险

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

五、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产受损。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外因素的出现，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

六、本基金的特定风险

1、指数投资风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为深证 100 价格指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

指数编制开发与计算维护受诸多因素影响，其中多数因素不受控制。因市场结构变化、产品定义调整，或其他原因导致指数不再对其衡量的标的具有代表性等极端情况均可能导致指数终止。

（1）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 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。

（2）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。

（3）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）停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

2、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除承担境内上市交易股票投资的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）转换基金运作方式；

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金份额持有人大会召开程序；

（9）终止《基金合同》；

（10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

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

（5）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合《指数基金指引》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及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费

用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十九部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利、义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集基金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，执行折算并根据基金份额的实际情况和每一个开放日瑞福优先的申购与赎回情况，确定两级基金的基金份额配比；

（12）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

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

（14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；

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

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

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额的申购与赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，基金份额净值两级基金的基金份额配比、瑞福优先约定年化收益率等；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制中期报告和年度基金报告等基金定期信息披露资料；

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

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

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

（14）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；

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

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

（17）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；

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

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

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

（21）当基金管理人依据法律法规，基于特定业务的需要将某项义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

（22）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；

（23）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

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

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

2、基金托管人的权利、义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

产；

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

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

（4）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值，基金份额净值瑞福优先年化约定收益率等；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益款项；

（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

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

分级运作期内，本基金每份瑞福优先和每份瑞福进取与其同类份额具有同等的合法权益。分级运作期结束，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金每份基金份额具有同

等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依照法律法规及《基金合同》的规定，依法转让其持有的瑞福进取基金份额，依法申请赎回其持有的瑞福优先基金份额；

（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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

（1）遵守《基金合同》；

（2）缴纳基金认购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（3）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

（6）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

1、本基金在分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由瑞福优先、瑞福进取的基金份额持有人独立进行表决。瑞福优先、瑞福进取的基金份额持有人持有的每一

份基金份额在其对应级别内拥有平等的投票权。

2、本基金根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）后，基金份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式，但本基金在根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）的情形时除外；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）(在分级运作期内，指持有瑞福优先及瑞福进取各自份额 10%以上)的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）(在分级运作期内，指代表瑞福优先及瑞福进取各自份额 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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）(在分级运作期内，指代表瑞福优先及瑞福进取各自份额 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。

5、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）(在分级运作期内，指代表瑞福优先及瑞福进取各自份额 10%以上)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）(在分级运作期内，指代表瑞福优先及瑞福进取各自份额 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。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。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人、转换基金运作方式以及提前终止或延期《基金合同》必须以现场开会方式召开。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额合计占本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）以上(在分级运作期内，指有效的瑞福优先及瑞福进取份额占各自基金总份额 50%以上)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决

截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额合计占权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）以上(在分级运作期内，指有效的瑞福优先及瑞福进取份额占各自基金总份额 50%以上)；

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

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

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上(在分级运作期内，指持有瑞福优先及瑞福进取各自份额 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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35

天前提交召集人并由召集人公告。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

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

单独或合计持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上(在分级运作期内，指持有瑞福优先及瑞福进取各自份额 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，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）(在分级运作期内，指参会的瑞福优先及瑞福进取基金份额持有人或其代理人所持各自类别表决

权 50%以上)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

瑞福优先、瑞福进取的基金份额持有人分别对基金份额持有人大会会议审议事项独立进行表决。瑞福优先、瑞福进取的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应级别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）(在分级运作期内，指经参会的瑞福优先及瑞福进取基金份额持有人或其代理人所持表决权各自 50%以上)通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）(在分级运作期内，指经参会的瑞福优先及瑞福进取基金份额持有人或其代理人所持表决权各自三分之二以上)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止或延期《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

（2）瑞福优先和瑞福进取的基金份额持有人表决结果应当分别进行清点与统计。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瑞福优先、瑞福进取以及总的基金份额的计票结果。

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

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

三、基金合同解除和终止的事由、程序

（一）《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）转换基金运作方式，但本基金在根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）的情形时除外；

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金份额持有人大会召开程序；

（9）终止《基金合同》；

（10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

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

（5）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执

行，自《基金合同》生效之日起按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合《指数基金指引》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及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

1、本基金在分级运作期内清算时的基金清算财产分配

本基金在分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足瑞福优先的本金和约定收益分配，剩余部分（如有）由瑞福进取的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

2、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议解决方式

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

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

第二十部分 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：国投瑞银基金管理有限公司

住所：上海市虹口区杨树浦路 168 号 20 层

法定代表人：叶柏寿

成立时间：2002 年 6 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25 号

注册资本：1 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金管理业务；设立与发起基金；特定客户资产管理；境外证券投资管理及经中国证券监督管理委员会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：（0755）83575992

传真：（0755）82904048

联系人：杨蔓

2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：蒋松云

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

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

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险兼业代理业务（有效期至 2008 年 9 月 4 日）；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证，下同）、债券、股指期货、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金自 2012 年 7 月 17 日起不超过 30 日的期间为本基金的过渡期；本基金过渡期结束后的下一工作日开始为本基金分级运作期的起始日；基金分级运作期为 3 年。分级运作期届满后，本基金转换为“国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）”。在分级运作期内，当出现以下情形之一时，本基金

将提前转型为“国投瑞银瑞福深证 100 指数证券投资基金（LOF）”：

①瑞福进取份额净值小于或等于 0.25 元；

②瑞福优先份额少于 5000 万份。

在正常情况下，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于深证 100 指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

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

本基金在分级运作期开始后的 3 个月内，以及分级运作期到期前 6 个月内，基金的投资资产配置可不受上述比例的限制。

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

①本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

②基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的 90%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

④本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

⑤本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑥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；

⑦本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

⑧相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

本基金在分级运作期开始后的 3 个月内，以及分级运作期到期前 6 个月内，基金的投资资产配置可不受上述比例的限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，在履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

（3）法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第④、⑤、⑥项外，由于证券市场波动、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。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

（5）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但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其基金管理人、基金托管人发行的股票

或债券；

（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）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

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

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

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

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

（1）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。

基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

（2）基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

（3）基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

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

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

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

（4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。即增加已持有流通受限证券市值占资产净值的比例的提供，从而使审核指标更为完整。

（5）基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

（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

值计算和基金份额净值、两级基金的基金份额净值计算、瑞福优先约定年化收益率计算、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）基金托人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反有关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人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，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及两级基金的基金份额净值、瑞福优先约定收益率，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。

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

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

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

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

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

（二）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存

款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

基金托管人可通过对原有瑞福分级股票型证券投资基金的相关账户办理更名后延续使用。

（三）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

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

基金管理人和基金托管人可通过向中国证券登记结算有限责任公司申请对原有瑞福分级股票型证券投资基金的相关账户办理更名后延续使用。

（四）债券托管账户的开立和管理

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

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

3、基金管理人和基金托管人可通过向中央国债登记结算有限责任公司申请对原有瑞福

分级股票型证券投资基金的相关账户办理更名后延续使用。

（五）其他账户的开设和管理

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

（六）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（七）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

五、基金净值信息计算与会计核算

（一）基金净值信息的计算

1、基金净值信息的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额余额后的数值。在计算得出基金份额净值后，根据本基金《基金合同》约定的计算公式，在本基金的分级运作期计算两级基金的基金份额净值；在本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，计算本基金的基金份额净值。

基金份额净值和两级基金的基金份额净值计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位

四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》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及分级运作期内两级基金的基金份额净值，由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值和基金份额累计净值予以公布。

基金净值信息等的计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人的计算结果对外予以公布。

（二）基金资产估值方法

1、估值对象

基金所拥有的股票（含存托凭证）、债券、权证、股指期货等金融衍生品和银行存款本息等资产和负债。

2、估值方法

本基金的估值方法为：

（1）已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票，以其估值日证券交易所提供的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

在证券交易所市场流通的债券和权证，按如下估值方式处理：

A、实行净价交易的债券按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

B、未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

C、已上市流通的权证，以其估值日证券交易所提供的收盘价估值。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值；

B、首次公开发行的股票和未上市债券，按成本估值；

C、处于未上市期间的权证或者不存在活跃市场的权证，例如权证发行至上市日之间、权证停牌日等情况，可应用 B-S 模型等估值技术确定其公允价值。

（3）银行间债券市场债券按估值技术确认的公允价值估值。

（4）配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

（5）基金持有的股指期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（6）在任何情况下，基金管理人如采用前述第（1）-（5）所列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。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

（7）债券利息收入、存款利息收入、买入返售证券收入等固定收益的确认采用权责发生制原则。

（8）股利收入的确认采用权责发生制原则。

（9）本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

基金管理人和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，应及时改正，并报告中国证监会。对基金或基金份额持有人造成损害的，按各自应承担的责任对基金或基金份额持有人进行赔偿。

（三）估值差错处理

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

当基金管理人计算的基金净值信息及分级运作期内两级基金的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托

管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值及分级运作期内两级基金的基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

如果上述两种情况在某一估值差错事件中同时发生，由此造成投资者或基金的损失，由基金管理人和基金托管人协商进行赔偿。

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。

当基金管理人计算的基金净值信息及分级运作期内两级基金的基金份额净值等与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值、基金份额净值及分级运作期内两级基金的基金份额净值等的计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、瑞福进取的基金份额上市交易的前一日、分级运作期的最后一日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额名称与基金份额。

本基金在分级运作期内，瑞福优先的基金注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，瑞福进取的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司；本基金在转换为上市开放式基金（LOF）之后，基金份额的基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应及时向基金托管人提交以下日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、瑞福进取的基金份额上市交易的前一日、分级运作期的最后一日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额名称与基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

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

七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

八、托管协议的变更与终止

（一）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

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

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（二）基金财产的清算

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

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

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

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

5、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

（1）本基金在分级运作期内清算时的基金清算财产分配

本基金在分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足瑞福优先的本金和约定收益分配，剩余部分（如有）由瑞福进取的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

（2）本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金根据《基金合同》的约定转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、销售机构提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

（一）基金份额持有人的对账单服务

1、基金份额持有人可登录基金管理人网站查阅对账单。

2、基金管理人至少每年度以电子邮件、短信或其他形式向通过国投瑞银直销系统持有基金管理人基金份额的持有人提供基金保有情况信息，基金份额持有人也可以向基金管理人定制电子形式的月度对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见基金管理人网站或拨打客服热线咨询。

3、由于投资者提供的手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过基金管理人网站，或拨打基金管理人客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

（二）呼叫中心电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话收听基金份额净值，自助查询基金账户余额和交易信息等。

客户服务部的人工坐席服务时间为每周一至周五 9：00—18：00，周六 9：00—17：00（法定节假日及因此导致的证券交易所休市日除外）。

客服热线：4008806868、0755-83160000

（三）在线服务

基金管理人利用基金管理人的网站（www.ubssdic.com）为基金投资者提供网上查询、网上资讯服务。

（四）投诉受理服务

投资者可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复，对于不能及时回复的投诉，基金管理人将在 48 小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，原则上顺延至下一工作日当日或次日回复。

客服邮箱：service@ubssdic.com

第二十二部分 其他应披露事项

1、本基金管理人和本基金托管人在本报告期内无重大诉讼事项。

2、最近 3 年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到行政处罚。

3、2023 年 8 月 19 日，本基金管理人在规定媒介刊登国投瑞银基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告。

4、2023 年 10 月 10 日，本基金管理人在规定媒介刊登国投瑞银基金管理有限公司关于本公司及北京分公司办公地址变更的公告。

5、2024 年 5 月 24 日，本基金管理人在规定媒介刊登国投瑞银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息及投资者适当性信息的公告。

第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

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

第二十四部分 备查文件

（一）中国证监会《关于核准国投瑞银瑞福分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2012]880 号）

（二）《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》

（三）《国投瑞银瑞福深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）中国证监会要求的其他文件

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查询，但应以基金备查文件正本为准。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇二四年六月二十七日

附件一：标的指数编制方案

（最新的指数编制方案可登录指数公司网站查询）

_

指数编制方案
Methodology

深证 100 指数编制方案

为反映深圳市场核心优质上市公司的股价变动走势，提供可交易的指数产品和金融衍生工具的标的物，编制深证 100 指数。

一、代码与名称

指数名称：深证 100 指数
指数简称：深证 100
英文名称：Shenzhen 100 Index
英文简称：Shenzhen 100
指数代码：399330

指数名称：深证 100 全收益指数
指数简称：深证 100R
英文名称：Shenzhen 100 Total Return Index
英文简称：Shenzhen 100 TRI
指数代码：399004

二、基日与基点

1 / 9

指数基日为 2002 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

在深圳证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：

1. 非 ST、*ST 股票；
2. 上市时间超过六个月，A 股总市值排名位于深圳市场前 1%的股票除外；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
5. 考察期内股价无异常波动。

四、选样方法

首先，计算入围选样空间股票在最近半年的 A 股日均总市值和 A 股日均成交金额；

其次，对入围股票在最近半年的 A 股日均成交金额按从高到低排序，剔除排名后 10%的股票；

然后，对选样空间剩余股票按照最近半年的 A 股日均总市值从高到低排序，选取前 100 名股票构成指数样本股。

在排名相似的情况下，优先选取行业代表性强、盈利记录良好的上市公司股票作为样本股。

五、指数计算

深证 100 指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

$$\text{实时指数} = \text{上一交易日收市指数} \times \frac{\sum(\text{样本股实时成交价} \times \text{样本股权数})}{\sum(\text{样本股上一交易日收市价} \times \text{样本股权数})}$$

样本股：指纳入指数计算范围的股票。

样本股权数：为样本股的自由流通量，分子项和分母项的权数相同。

自由流通量：上市公司实际可供交易的流通股数量，它是无限售条件股份剔除“持股比例超过 5%的下列三类股东及其一致行动人所持有的无限售条件股份”后的流通股数量：①国有（法人）股东；②战略投资者；③公司创建者、家族或公司高管人员。

自由流通市值：股票价格乘以自由流通量。

分子项：为样本股实时自由流通市值之和。

分母项：为样本股上一交易日收市自由流通市值之和。

股票价格选取：以样本股集合竞价的开市价计算开市指数，以样本股的实时成交价计算实时指数，以样本股的收市价计算收市指数。样本股当日无成交的，取上一交易日收市价。样本股暂停交易的，取最近成交价。

六、样本股定期调整

1. 考察期

指数样本股每半年调整一次。样本股考察期为半年，考察截止日为每年的 4 月 30 日和 10 月 31 日。每年 5 月份审核样本股时，参考依据一般是上一年度 11 月 1 日至审核年度 4 月 30 日的交易数据及财务数据；每年 11 月份审核样本股时，参考依据一般是审核年度 5 月 1 日至 10 月 31 日的交易数据及财务数据。

2. 调整时间

样本股定期调整于每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本股调整方案通常在实施前两周公布。

3. 调整数量

每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。

4. 缓冲区规则

排名在样本数 70%范围之内的非原样本股按顺序入选，排名在样本数 130%范围之内的原样本股按顺序优先保留。

5. 备选样本股

在确定新入选成份股后，在剩余股票中按日均总市值从高到低排序选取样本数量 5%的股票作为备选样本股。

七、样本股临时调整

1. 快速入选规则

新上市股票若在上市后的 5 个交易日内，平均 A 股总市值排名位于深圳市场前 10 名，则在上市 15 个交易日之后快速入选样本股，同时从指数中剔除平均 A 股总市值排名最低的原样本股。

上市公司因并购重组等行为，平均 A 股总市值排名进入深圳市场前 10 名，参照新上市股票快速入选规则处理。

2. 收购合并

样本股公司合并：合并后的新公司股票保留样本股资格，产生的样本股空缺由备选样本股名单中排序最靠前的股票填补。

样本股公司合并非样本股公司：合并后的新公司股票保留样本股资格。

非样本股公司合并样本股公司：若合并后的新公司股票排名高于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则新公司股票成为指数样本，否则，备选样本股名单中排序最靠前的股票作为指数样本。

3. 分拆

样本股公司分拆为多家新公司，新公司能否入选指数样本根据其排名而定：

若新公司股票的排名高于原样本股中排名最低的股票，则该新公司股票入选指数样本股。若入选数量超过 1 只，则剔除原样本股中排名最低的股票，保持指数样本股数量不变。

若新公司股票的排名全部低于原样本股中排名最低的股票，但全部或部分公司股票的排名高于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则新公司股票中排名最高的股票入选指数样本股。

若新公司股票的排名全部低于原样本中排名最低的股票，同时低于备选样本股名单中排序最靠前的股票，则备选样本股名单中排序最靠前的股票入选指数样本股。

4. 退市

样本股终止上市的，从进入退市整理期的第一个交易日起，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

样本股公司因重大违规行为（如财务报告造假），可能被暂停或者终止交易的，经指数专家委员会审议后，将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

5. 实施风险警示

样本股被交易所实施风险警示（ST 或*ST）的，从实施风险警示次月的第二个星期五的下一个交易日起将其从指数样本中剔除，选择备选样本股名单中排序最靠前的股票补足。

八、指数备选样本股

在指数定期样本审核时，设置备选样本股名单，用于指数样本股定期调整之间的临时调整。

当指数出现样本股退市、实施 ST 或*ST 等事项需要临时更换样本时，依次选择指数备选股名单中排序最靠前的股票作为样本股。

备选样本股数量一般为指数样本数量的 5%，备选名单随同定期调整名单向市场公布。当备选样本股数量不足 50%时，将及时补充并公告备选样本股名单。

九、指数的调整计算

1. 调整母项中某样本股的上一交易日收市价

对于全收益指数，当样本公司进行派息、送股、配股、转增或其他除权情形时，在除权除息日将母项中该公司股票的股权登记日收市价更新为除权参考价。除权参考价以深圳证券交易所发布为准。

对于价格指数，现金分红在除息日不作除权调整，其余处理方法同全收益指数。

2. 调整子项和母项中某样本股的权数（自由流通量）

（1）实时调整

样本股公司进行送股、转增等权益分配及配股时，在除权日对样本股的自由流通量进行调整。

样本股公司进行增发、配股时，在其新增股份上市日对样本股的自由流通量进行调整。

样本股公司进行债转股、股份回购、权证行权时，在其公

告日的下一个交易日进行调整。

（2）集中调整

样本股公司因大股东增（减）持、限售股上市等非公司行为引起的自由流通量变化，在每年 6 月、12 月的第二个星期五的下一个交易日，根据上市公司最新定期报告与临时公告中公布的股东持股数据进行集中调整。

十、指数的发布与管理

1. 深证 100 指数的发布

指数行情通过如下渠道向国内外发布：

（1）通过深交所行情发布系统和行情互联网接入服务，实时发布指数行情；

（2）通过深证通、FTP 等数据传输通道每日对外发布；

（3）通过国证指数网（www.cnindex.com.cn）每日对外发布。

2. 深证 100 指数的管理

深证 100 指数由深圳证券交易所授权并委托深圳证券信息有限公司编制、维护和管理。深圳证券信息有限公司指数事业部定期对样本股的代表性进行考察，根据考察结果审议是否更换样本股。

深证 100 指数属于深圳证券交易所资产，未经深交所或深圳证券信息公司书面许可，任何单位或个人不得跟踪、交易该

指数，或以该指数为评价基准。

十一、免责声明

本文件和其中的所有信息，包括但不限于所有的文字、数据、图表、表格属于深圳证券信息有限公司的财产，受中国知识产权法律及相关法律保护。未经深圳证券信息有限公司书面许可，不得将这些信息全部或部分复制或再次传播。

本文件及其中任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议，也不表示深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司及其关联方关于任何发行人、证券、金融产品或工具或交易策略的意见。

对任何直接或间接使用本文件及其任何信息而造成的损失，包括但不限于因内容不准确、不完整而导致的损失，深圳证券交易所、深圳证券信息公司及其关联方无须承担任何法律责任。