大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金托管协议

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

鉴于大成基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；

鉴于中国银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；

鉴于大成基金管理有限公司拟担任大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金的基金管理人，中国银行股份有限公司拟担任大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金的基金托管人；

为明确大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

一、托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：大成基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 层

法定代表人：吴庆斌

设立日期：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字【1999】10 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：0755-83183388

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

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

存续期间：持续经营

二、托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本协议依据《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《商业银行托管业务监督管理办法（试行）》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关法律法规与《大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。

（二）目的

订立本协议的目的是明确大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金基金托管人和大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（三）原则

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

（四）解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《基金合同》的相应术语具有相同含义。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：

1、对基金的投资范围投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票、存托凭证证券库提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）。

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于股指期权等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%；投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

2、对基金投融资比例进行监督；

（1）本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（5）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持

证券规模的 10%；

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

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

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

（9）本基金参与股指期货交易遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产的 90%；

（10）本基金参与国债期货交易遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定，即投资比例不超过基金资产的 10%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（11）本基金参与股票期权交易遵守下列要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（12）本基金参与转融通证券出借业务，应当符合下列投资限制：出借证券资产不得

超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；本基金参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（13）本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（14）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（15）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述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（16）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本基金合同约定的投资范围保持一致；

（17）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；

（18）法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第（2）、（7）、（12）、（15）、（16）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准。

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

（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、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核，发现错误的，应当及时提示基金管理人。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回复并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

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

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

（六）对于需要外部市场公共数据支持才可以实现监督的监控指标，基金托管人不负责外部数据的真实性、准确性与完整性。对于需要基金管理人提供材料支持才可以实现监督的监督指标，基金托管人不负责此部分材料的真实性、准确性与完整性，对因为基金管理人提供材料不真实、不准确、不完整或不及时导致基金托管人无法开展有效监督的情形，基金托管人不承担任何责任。

（七）基金托管人对基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)、投资回报以及基金财产的信用风险、市场风险不承担任何责任，对投资项目及交易信息真实性、

基金资金来源的合法合规性不作任何担保、暗示或表示并对由此所引起的损失不负相应责任。

（八）基金管理人应配合履行反洗钱和制裁合规义务，在符合当地法律法规、监管规定的前提下，按基金托管人反洗钱和制裁合规尽职调查要求，提供和更新本机构及受益所有人信息，提供有关交易的背景信息等。

基金管理人应建立健全客户尽职调查等反洗钱和制裁合规内部控制机制，落实客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、交易监测、大额和可疑交易报告、名单监控等相关监管要求。确保资金使用合法，不涉及洗钱、恐怖融资、制裁违规或其他违法犯罪活动

基金管理人应按照监管要求开展产品尽职调查和受益所有人识别，并向基金托管人提供产品及其受益所有人信息。如产品的受益所有人发生变化，基金管理人应及时通知托管人，并提供变更后的产品受益所有人信息。

四、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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

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

五、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。

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

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

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

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

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件， 由基金管理人按规定办理退款等事宜。

（三）基金的托管账户的开设和管理

1、基金托管人负责办理本基金托管账户开设，基金管理人应当给予必要的配合。

2、基金托管人以基金名义在基金托管人处开设本基金的托管账户，基金托管账户名称应当包括开户主体和产品名称字样，与基金产品名称相对应。基金托管账户的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金托管账户的一切资金划拨由基金托管人负责依据基金管理人根据本协议约定出具的指令、授权或本协议约定的其他情形进行划拨，基金管理人和基金托管人不得自行划拨。本基金的一切货币收支活动包括但不限于投资、支付赎回金

额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。基金托管人对已划出基金托管账户以及处于基金托管人实际控制之外的基金财产不承担保管责任。

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

4、基金托管账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（四）证券资金账户的开立和管理

基金管理人根据相关法律法规及协议约定在选定的证券经纪商处为本基金开立证券资金账户，用于办理本基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务，该账户对应的指定收款账户为本基金托管账户。第三方存管模式下，证券交易资金账户只能选定本基金托管账户作为唯一银行结算账户，如需变更必须征得基金托管人同意。

（五）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，存款账户名称原则上应当与托管账户名称一致，与基金产品名称相对应。基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（六）基金证券账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当以本基金的名义在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）开设证券账户，证券账户的开设及管理遵照中国结算相关业务规则执行。

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

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

（七）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。债券账户的开设及管理遵照中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司相关业务规则执行。

（八）期货结算账户的开立和管理

基金管理人应当代表本基金，按照相关规定开立期货结算账户，在中国金融期货交易所获取交易编码，在基金托管人指定银行办理银期转账申请业务。期货结算账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

（九）基金财产投资的有关有价凭证的保管

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

（十）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致并加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

（十一）基金财产相关账户的注销

本基金清盘结束、或未运作、或发生其他应销户情形时，基金管理人应按照法律法规要求尽快向基金托管人提交书面销户申请，配合基金托管人完成相关账户的注销。

六、指令的发送、确认及执行

（一）指令的内容

指令是基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及投资结算指令。

（二）指令的形式

基金管理人发送的指令包括电子指令和线下指令。

电子指令包括基金管理人发送的电子指令（采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、采用 SWIFT 电子报文发送的电子指令、通过中国银行托管网银发送的电子指令）、自动生成的电子指令（基金托管人根据基金管理人的授权通过预先设定的业务规则通过系统自动生成的电子指令）。电子指令一经发出即被视为合法有效指令。基金管理人通过深证通金融数据交换平台发送的电子指令，基金托管人根据 USER ID 和 APP ID 唯一识别基金管理人身份，基金管理人应妥善保管 USER ID 和 APP ID，基金托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的任何损失基金托管人不承担责任。

线下指令指以传真、邮件等双方认可的方式传送的指令。

（三）线下指令的授权与发送

1、基金管理人对发送线下指令人员的书面授权

基金管理人应当事先向基金托管人发出书面通知（以下称“授权通知”），载明基金管理人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”）及各个人员的权限范围。基金管理人应向基金托管人提供指令发送人员的人名印鉴的预留印鉴样本和签字样本。

基金管理人向基金托管人发出的授权通知（含变更授权通知）应加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人向基金托管人以传真或邮件的形式发送授权通知（含变更授权通知）后同时电话通知基金托管人。授权通知自基金托管人接到基金管理人的电话确认后于通知载明的生效时间起生效。通知载明的生效时间不得早于电话确认时间。基金管理人在此后 3 个工作日内将授权通知原件送交基金托管人。

基金管理人和基金托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

2、线下指令的发送由“授权通知”确定的指令发送人员代表基金管理人用传真、邮件或其他双方确认的方式向基金托管人发送。对于指令发送人员发出的指令，基金管理人不得否认其效力。

（四）指令的发送、确认和执行

1、基金管理人应按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，基金管理人应及时通过电话或其他双方认可的方式通知基金托管人，确保指令成功传送至基金托管人。因基金管理人未及时通知基金托管人，致使资金未能及时到账所造成的损失不由基金托管人承担。

2、基金托管人在接收指令时，应对指令的要素是否齐全、印鉴是否与授权通知相符等进行表面一致性的检查。对合法合规的指令，基金托管人应在规定期限内执行，不得不合理延误。

3、对于银行间业务，如需发送银行间成交单的，基金管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单经有权人员签字并加盖印章后及时发送给基金托管人。如不需采用发送交易成交单的形式，基金管理人应对基金托管人进行书面授权确认。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止，基金管理人需书面通知基金托管人。

4、基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令时所必需的时间。指令传输不及时或未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由基金管理人承担。

（五）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形主要包括：指令要素错误、预留印鉴错误及其他本协议约定的情形。

基金托管人发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。对基金管理人更正并重新发送后的指令经基金托管人核对确认后方能执行。

（六）基金托管人依照法律法规拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律法规规定或者《基金合同》约定，应当不予执行，并及时通知基金管理人要求其变更或撤销相关指令，若基金管理人在基金托管人

发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，基金托管人应当拒绝执行，并向中国证监会报告。

基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金的银行存款账户有足够的资金余额，确保基金的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，基金托管人可不予执行，但应及时通知基金管理人，由此造成的损失，由基金管理人承担。

（七）基金托管人未按照基金管理人指令执行的处理方法

基金托管人因未正确执行基金管理人合法合规的指令，致使本基金的利益受到损害，基金托管人应及时采取措施予以补救，并承担相应的责任。除此之外，基金托管人对执行基金管理人的合法合规指令对基金造成的损失不承担任何责任。

七、交易及清算交收安排

（一）基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券、期货经纪机构

基金管理人根据相关法律法规规定选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并承担相应责任。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议，并按照法律法规的规定向中国证监会报告和信息披露有关内容。基金管理人应及时将基金佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。

基金管理人负责根据法律法规规定选择代理本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行。

（二）基金清算交收

1、本基金通过证券经纪机构进行的交易所场内交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。该证券经纪机构应当具有证券投资基金的结算经验，有完善的技术设施配备、人员配置和管理制度，能够保障数据接收、发送的及时性和准确性。

基金管理人、基金托管人以及被选择的证券经纪机构应根据有关法律法规及相关业务规则，签订证券经纪服务协议，用以具体明确三方在证券交易资金结算业务中的责任。

2、本基金投资于证券发生的所有场外交易的资金清算交收，由基金托管人负责办理。场外资金对外投资划款由基金托管人凭基金管理人符合本托管协议约定的有效资金划拨指

令进行资金划拨；场外投资本金及收益的划回，由基金管理人负责协调相关资金划拨回资金托管账户事宜。

3、本基金投资于期货发生的资金交割清算由基金管理人选定的期货经纪公司负责办理，基金托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不承担保管职责和交收职责，基金管理人应在期货经纪协议或其它协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任和交收责任。

4、由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。

5、如果因为基金管理人违反法律法规的规定进行证券投资或违反双方签订的协议造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后应及时通知基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金造成的损失由基金管理人承担。

6、基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金托管账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令，由此造成的损失，由基金管理人承担。

7、基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间。对于要求当天到账的指令，应在当天 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时发送，并保证相关付款条件已经具备。对于新股申购网下公开发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T 日)的前一工作日下班前将新股申购缴款指令发送给基金托管人，最迟不应晚于 T 日上午 10：00 时。

（三）资金、证券账目和交易记录核对

基金管理人和基金托管人应对本基金的资金、证券账目及交易记录每个估值日进行对帐。

（四）申购、赎回和基金转换的资金清算

基金管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式基金的数据传送给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式基金的数据真实性、准确性和完整性负责。

基金申购、赎回、转换等款项的资金清算采用轧差交收的结算方式，在基金托管账户与“基金清算账户”间进行资金交收。当存在托管账户净应收额时，基金管理人负责将托管账户净应收额在交收日 16:00 前从“基金清算账户”划到基金托管账户；当存在托管账

户净应付额时，基金托管人按管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日 16:00 前划到“基金清算账户”。

基金管理人未能按上款约定将托管账户净应收额全额、及时汇至基金托管账户，由此产生的责任应由该基金管理人承担；基金托管人未能按上款约定将托管账户净应付额全额、及时汇至“基金清算账户”，由此产生的责任应由基金托管人承担(不可抗力或基金托管人无过错的情况除外)。

八、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人每个估值日按基金份额类别计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业会计准则》及其他法律法规的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后以双方约定的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。基金管理人未接受基金托管人关于基金份额净值计算的复核意见而进行信息披露的，由此产生的相应责任由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

3、如有确凿证据表明相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、银行存款本息、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、应收款项、其它投资等资产及负债。

2、估值方法

(1) 证券交易所上市的股票品种的估值

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

2) 交易所上市不存在活跃市场的股票品种，采用估值技术确定公允价值。

(2) 处于未上市期间的股票品种应区分如下情况处理：

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

2) 首次公开发行未上市的股票品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。

(4) 已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时将充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）

后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(5) 对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

(6) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

(7) 对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，基金管理人在与托管人协商一致后，可采用第三方估值基准服务机构提供的推荐价格或者价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

(8) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

(10) 本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

(11) 本基金参与融资和转融通证券出借业务的，将按法律法规或参照行业协会的相关规定进行估值。

(12) 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，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(13) 本基金存入银行或其他金融机构的各种款项以本金列示，按协议或约定利率逐日确认利息收入。

(14) 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

(15) 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方法估值。

(16) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

(17) 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。

若无法从其他渠道获取可靠数据进行会计核算，仅依赖基金管理人提供数据的，托管人不承担因该数据有误而产生的相应责任。

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对各类基金份额净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，基金托管人不承担任何责任。

（三）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

（四）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》及下述约定处理份额净值错误。

1、当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通知基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当通知基金托管人，在报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

2、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金管理人对外公布的基金净值经基金托管人复核同意的，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任，基金托管人不承担基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露产生的责任；基金托管人对基金管理人提供的原始数据和信息的真实性、准确性和完整性所引起的任何损失不负责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返

还金额进行分配。如果因上述基金管理人提供的原始数据和信息不真实、不准确或不完整造成了基金托管人的损失的，基金托管人有权要求基金管理人承担相应责任。

3、由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、第三方估值机构发送的数据错误，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免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

4、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。基金托管人不承担基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露的责任。

（五）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（六）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（七）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（八）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

3、财务报表的编制与复核时间安排

基金管理人、基金托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制及复核；在上半年结束之日起 2 个月内完成基金中期报告的编制及复核；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

九、基金收益分配

（一）基金收益分配的依据

收益分配应该符合《基金合同》关于收益分配原则的规定。

（二）基金收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人根据《基金合同》的相关规定制定。

2、基金管理人应于收益分配日之前将其制定的收益分配方案提交基金托管人复核，基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核，复核通过后基金管理人应及时公告；如果基金管理人与基金托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致，基金托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明书面通知基金管理人，在上述文件提交完毕之日起基金管理人有权利对外公告其拟订的收益分配方案，且基金托管人有义务协助基金管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及《基金合同》的除外。

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

4、基金托管人根据基金管理人的收益分配方案和提供的现金红利金额的数据，在红利发放日将分红资金划入基金管理人指定账户。如果投资者选择转购相应类别的基金份额，基金管理人和基金托管人则应当进行红利再投资的账务处理。

十、基金信息披露

（一）保密义务

除按照法律法规中关于基金信息披露的有关规定进行披露以外，基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应恪守保密的义务。基金管理人与基金托管人对基金的任何信息，除法律法规规定之外，不得在其公开披露之前，先行对任何第三方披露。但是，如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：

1、非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

2、基金管理人和基金托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开；

3、因审计、法律等专业服务向外部专业顾问提供信息，并要求专业顾问遵守保密义务。

（二）基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、基金管理人和基金托管人应根据相关法律法规、《基金合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。

2、对于产品管理人或其他相关方拟披露信息中明确需托管人复核的内容，托管人以自身能够获取的数据和信息为限，在约定时间内进行表面一致性、数据准确性复核。

3、托管人对信息的复核不构成对该等信息内容的真实性、完整性、准确性或合法性的任何保证或承诺，亦不减轻或免除产品管理人作为信息披露义务人的任何责任。

4、本基金信息披露的所有文件，包括《基金合同》和本协议规定的定期报告、临时报告、基金净值信息及其他必要的公告文件，由基金管理人和基金托管人按照有关法律法规的规定予以公布。

5、基金年度报告中的财务会计报告必须经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

6、本基金的信息披露，应通过符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介进行；基金管理人、基金托管人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规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

7、信息文本的存放与备查

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，供社会公众查阅、复制。基金管理人、基金托管人应为文本存放、基金份额持有人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

8、对于因不可抗力等原因导致基金信息的暂停或延迟披露的（如暂停披露基金净值信息），基金管理人应及时向中国证监会报告，并与基金托管人协商采取补救措施。不可抗力等情形消失后，基金管理人和基金托管人应及时恢复办理信息披露。

9、本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同的规定进行信息披露。

（三）暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

1、不可抗力；

2、发生暂停估值的情形；

3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

（四）基金托管人报告

基金托管人应按《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》和其他有关法律法规的规定于每个上半年度结束后两个月内、每个会计年度结束后三个月内在基金中期报告及年度报告中分别出具基金托管人报告。

（五）信息保护

基金托管人应当按照法律法规要求有效保护和合理利用托管业务数据及基金管理人、基金份额持有人的信息。

十一、基金费用

（一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H = E × 0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（二）基金托管人的托管费

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

H = E × 0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（三）C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。通过直销机构认购/申购本基金 C 类基金份额不收取销售服务费，通过直销机构以外的其他销售机构认购/申购 C 类基金份额且持有未超过 1 年的，收取销售服务费。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H = E × 0.20%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提。

（1）基金管理人直销渠道：

对于基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）代销渠道：

对于投资者持续持有期限不超过一年（即 365 天，下同）的基金份额收取的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付。 由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

对于持续持有期限超过一年的基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。持续持有期为基金合同生效日（针对募集期内认购的基金份额）或该笔基金份额申购、转入确认日与赎回、转出确认日或基金最后运作日下一工作日的间隔天数。

销售服务费计提后按规定收取或返还投资者的金额以登记机构的计算结果为准，托管人无需复核。

（四）从基金财产中列支基金管理人的管理费、基金托管人的托管费以及 C 类基金份额的销售服务费之外的其他基金费用，应当依据有关法律法规、《基金合同》的规定执行。

（五）对于违反法律法规、《基金合同》、本协议及其他有关规定（包括基金费用的计提方法、计提标准、支付方式等）的基金费用，不得从任何基金财产中列支。

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

十二、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

十三、基金有关文件档案的保存

（一）基金管理人应保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，基金托管人应保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

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

十四、基金托管人和基金管理人的更换

（一）基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值与净值。

（二）基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值与净值。

（三）其他事宜见《基金合同》的相关约定。

十五、禁止行为

（一）《基金法》禁止的行为。

（二）《基金法》禁止的投资或活动。

（三）除根据基金管理人的指令或《基金合同》、本协议另有规定外，基金托管人不得动用或处分基金财产。

（四）基金管理人、基金托管人的高级管理人员和其他从业人员不得相互兼职。

（五）法律法规、《基金合同》和本协议禁止的其他行为。

法律法规或监管部门调整或取消上述限制的，本基金从其规定。

十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当依据法律法规规定报中国证监会备案。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，经履行相关程序后，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、基金管理人、基金销售机构不得借助基金托管人的品牌、声誉开展不当营销宣传。若基金管理人、基金销售机构借助基金托管人的品牌、声誉开展不当营销宣传的，基金托管人有权督促其立即纠正。基金管理人、基金销售机构经基金托管人书面通知后未在 5 个工作日内完成整改的，基金托管人有权单方终止业务合作，并由不当营销宣传的基金管理人或基金销售机承担由此产生的一切费用及法律责任。自基金托管人向基金管理人、基金销售机构送达书面终止通知之日起，本协议终止。

5、基金管理人存在违反资产管理目的，不当处分基金财产或存在拒不履行本协议、被依法取消业务资格、被依法解散撤销等情形，基金托管人有权终止托管服务。如基金管理人拒不签署终止协议或未落实继任托管人，托管银行有权采用止付措施，或公告解除托管

合同，不再履行托管职责。基金托管人终止托管服务的，应当根据规定，采取有关措施保护财产安全，并及时告知相关方。

6、具备以下情形之一的，基金托管人有权采取必要的风险管控措施，包括但不限于拒绝交易、限制交易、中止或终止业务合作、关闭账户、退出客户关系等：

（1）基金管理人拒绝配合基金托管人开展尽职调查或提供虚假、不实信息，或未在指定期限内提供信息；

（2）基金管理人或其交易涉嫌洗钱、恐怖融资、核武器扩散、违反制裁规定、其他违法违规行为；

（3）基金管理人受到联合国、中国或其他需适用制裁发布主体的制裁；

（4）出于执行我国反洗钱法律规定、基于履行反洗钱义务的必要；

(5)其他涉嫌违反中国或其他需适用的法律法规或监管规定的行为。

7、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

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

十七、违约责任和责任划分

（一）本协议当事人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

（二）因本协议当事人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责：

1、基金管理人及/或基金托管人按照届时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失；

2、基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失；

3、不可抗力；

4、基金托管人不对已划出托管账户以及处于自身实际控制之外的资产承担保管责任；基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由证券公司等其他机构负责清算交收的基金资产及其收益不承担任何责任；

5、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非基金管理人、基金托管人过错造成的意外事故。

（三）一方当事人违反本协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。

（四）因不可抗力不能履行本协议的，根据不可抗力的影响，违约方部分或全部免除责任，但法律另有规定的除外。当事人迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。

（五）一方当事人违约，非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（六）违约行为虽已发生，但本协议能够继续履行的，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。

（七）为明确责任，在不影响本协议本条其他规定的普遍适用性的前提下，基金管理人和基金托管人对由于如下行为造成的损失的责任承担问题，明确如下：

1、由于基金管理人下达违法、违规的指令所导致的责任，由基金管理人承担；

2、基金管理人的指令下达人员在授权通知载明的权限范围内下达的指令所导致的责任，由基金管理人承担，即使该人员下达指令并没有获得基金管理人的实际授权（例如基金管理人在撤销或变更授权权限后未能及时通知基金托管人）；

3、基金托管人未对指令上签名和印鉴与预留签字样本和预留印鉴进行表面一致性审核，导致基金托管人执行了应当无效的指令，基金管理人与基金托管人应根据各自过错程度承担责任；

4、属于基金托管人实际有效控制下的基金财产（包括实物证券）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；

5、基金管理人应承担对其应收取的管理费数额计算错误的责任。如果基金托管人复核后同意基金管理人的计算结果，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；但在不存在过错的前提下，基金托管人对基金管理人提供的原始数据和信息的真实性、准确性和完整性所引起的任何损失不负责任；

6、基金管理人应承担对基金托管人应收取的托管费数额计算错误的责任。如果基金托管人复核后同意基金管理人的计算结果，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；但在不存在过错的前提下，基金托管人对基金管理人提供的原始数据和信息的真实性、准确性和完整性所引起的任何损失不负责任；

7、由于基金管理人或基金托管人原因导致本基金不能依据中国结算的业务规则及时清算的，由责任方承担由此给基金财产、基金份额持有人及受损害方造成的直接损失，若由于双方原因导致本基金不能依据中国结算的业务规则及时清算的，双方应按照各自的过错程度对造成的直接损失合理分担责任；

8、在资金交收日，基金资金账户资金首先用于除新股申购以外的其他资金交收义务，交收完成后资金余额方可用于新股申购。如果因此资金不足造成新股申购失败或者新股申购不足，基金托管人不承担任何责任。如基金份额持有人因此提出赔偿要求，相关法律责任和损失由基金管理人承担。

（八）基金托管人不承担以下各项职责，且不对因该等职责相关事项所产生的任何损失承担责任：

1、承担基金财产的信用风险、市场风险等；

2、为基金提供直接或间接、显性或隐性担保，包括承诺本金或保证收益；

3、为基金垫付资金、提供流动性支持或融资承诺等；

4、参与投资者适当性管理；

5、保证投资项目及交易信息真实性；

6、保证基金资金来源的合法合规性；

7、对已划出托管账户以及处于基金托管人自身实际控制之外的资产承担保管责任；

8、参与基金管理人对基金的投资决策；

9、违规代替基金管理人向其他机构或者个人进行资产管理计划信息披露或提供相关数据信息；

10、基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任；

11、负责未兑付产品的资金追偿、财产保全、诉讼仲裁、债务重组和破产程序等，法律另有规定的除外；

12、因非基金托管人履职错误或过失造成的托管资产损失；

13、国务院金融监管部门规定的不属于资产托管人托管业务范围的其他职责。

十八、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本托管协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和台湾地区的有关规定）并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。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，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对双方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

十九、托管协议的效力

（一）基金管理人在向中国证监会申请基金募集注册时提交的基金托管协议草案，应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权代表签字或盖章并加盖公章，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。

（二）本协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。本协议的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本协议正本一式四份，协议双方各执一份，上报中国证监会和国家金融监督管理总局各壹份，每份具有同等法律效力。

二十、托管协议的签订

见签署页。

（以下无正文）

（本页为《大成恒生 A 股电网设备指数型发起式证券投资基金托管协议》签署页，无正文）

基金托管人:中国银行股份有限公司

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：

基金管理人：大成基金管理有限公司

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：