永赢基金管理有限公司

永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金
招募说明书

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

二〇二六年九月

重要提示

永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2026年8月28日获中国证券监督管理委员会证监许可〔2026〕2322号文准予注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金标的指数为中证工业有色金属主题指数，编制方案为：

1、选样空间

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 90%。

3、选样方法：

（1）对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取业务涉及铜、铝、铅锌、稀土金属、钨钼、钛等行业的上市公司证券作为待选样本；

（2）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 30 的证券作为指数样本，待选样本数量不足 30 只时全部纳入。

4、指数计算

指数计算公式为：

$$报告期指数=\frac{报告期样本的调整市值}{除数}\times 1000$$

其中，调整市值＝Σ(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 15%，多元化矿企单个样本权重上限不超过 3%，且前五大样本合计权重不超过 60%。

5、指数样本和权重调整

（1）定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第

二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：http://www.csindex.com.cn/。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。本基金是股票型证券投资基金，理论上预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金和货币市场基金。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，理论上具有与标的指数，以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资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、管理风险、操作风险、合规性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、本基金特有的风险以及其他风险等，具体风险详见招募说明书“风险提示”部分。

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生品（包括股指期货、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的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本招募说明书“风险提示”部分。

本基金可参与融资业务，当本基金将所持股票作为担保品进行融资时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担新投资股票带来的风险等。

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等。

本基金可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险、政策风险等。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等，详见本招募说明书的“风险提示”部分。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

本基金将股指期货纳入到投资范围当中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金将国债期货纳入到投资范围当中，国债期货是一种金融合约。投资于国债期货需承受市场风险、基差风险、流动性风险等。国债期货采用保证金交易制度，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

本基金将股票期权纳入到投资范围当中，股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险，可能给投资带来重大损失。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。本基金可根据投资策略需要或不同市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。

对于通过直销机构认购/申购C类基金份额收取的销售服务费，以及通过其他销售机构认购/申购并持续持有期限超过一年的C类基金份额继续收取的销售服务费采取先收后返模式，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额

可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

本基金在募集成立时（指本基金募集完成进行验资时）及运作过程中，单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过 50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外），且基金管理人承诺后续不存在通过一致行动人等方式变相规避 50%集中度要求的情形。基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理出资的不受上述限制。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，投资者在投资本基金前，应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，**但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。**

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者应当认真阅读并完全理解基金合同“违约责任”章节约定的免责条款、“争议的处理和适用的法律”章节约定的争议处理方式。基金合同约定的争议处理方式为仲裁。

目 录

重要提示.....1
第一部分 绪言.....8
第二部分 释义.....9
第三部分 基金管理人.....15
第四部分 基金托管人.....25
第五部分 相关服务机构.....28
第六部分 基金的募集.....30
第七部分 基金合同的生效.....36
第八部分 基金份额的申购与赎回.....37
第九部分 基金的投资.....53
第十部分 基金的财产.....64
第十一部分 基金资产估值.....65
第十二部分 基金的收益与分配.....72
第十三部分 基金费用与税收.....74
第十四部分 基金的会计与审计.....77
第十五部分 基金的信息披露.....78
第十六部分 侧袋机制.....85
第十七部分 风险提示.....88
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....101
第十九部分 基金合同内容摘要.....103
第二十部分 基金托管协议的内容摘要.....121
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....143
第二十二部分 其他应披露事项.....145
第二十三部分 招募说明书的存放和查阅方式.....146
第二十四部分 备查文件.....147

第一部分 绪言

《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》和其他有关规定以及《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

第二部分 释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金

2、基金管理人：指永赢基金管理有限公司

3、基金托管人：指平安银行股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金份额发售公告》

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

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

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

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

日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

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

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基

金份额发售、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划及提供基金交易账户信息查询等活动

25、销售机构：指永赢基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为永赢基金管理有限公司或接受永赢基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

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

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指相关证券交易所及相关期货交易所的正常交易日

35、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日或遇港股通因其他原因暂

停交易的情况，则本基金管理人有权决定是否暂停办理基金份额的申购、赎回或其他业务，并按规定进行公告）

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《永赢基金管理有限公司非上市开放式基金业务规则》及其不时做出的修订，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

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

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

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

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

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

47、元：指人民币元

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

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

53、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

54、标的指数：指中证工业有色金属主题指数

55、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及C类基金份额持有人服务的费用

56、A类基金份额：指在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，其中，通过直销机构认购/申购A类基金份额的不收取认购/申购费用

57、C类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。其中，通过直销机构认购/申购C类基金份额的不收取销售服务费；通过其他销售机构认购/申购并持续持有期限超过一年的C类基金份额，不再继续收取销售服务费

58、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

59、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，基金管理人可依据法律法规以及监管部门、自律规则的规定通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

60、转融通证券出借业务：指本基金以一定费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

62、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

63、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，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、瘟疫、社会动乱、非一方过错情况下的电力和通讯故障、系统故障、设备故障、网络黑客攻击以及中国证监会、交易所、证券业协会、基金业协会规定的其他情形

64、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制和深港股票市场交易互联互通机制

65、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

66、港股通交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所的正常交易，且能够满足结算安排的共同交易日。港股通交易日的具体安排，由上海证券交易所、深圳证券交易所的证券交易服务公司对市场公布

67、以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 21、22、23、27 层

法定代表人：马宇晖

设立日期：2013 年 11 月 7 日

联系电话：（021）5169 0188

传真：（021）5169 0177

联系人：沈望琦

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）是经中国证监会证监许可[2013]1280 号文件批准，于 2013 年 11 月 7 日成立的合资基金管理公司，初始注册资本为人民币 1.5 亿元，经工商变更登记，公司于 2014 年 8 月 21 日公告注册资本增加至人民币 2 亿元。

2018 年 1 月 25 日，公司完成增资，注册资本由人民币 2 亿元增加至人民币 9 亿元。

目前，公司的股权结构为：

宁波银行股份有限公司出资人民币 643,410,000 元，占公司注册资本的 71.49%；

Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 出资人民币 225,000,000 元，占公司注册资本的 25%；

上海稳进同赢企业管理中心（有限合伙）出资人民币 10,564,731.63 元，占公司注册资本的 1.1739%；

上海锐进同赢企业管理中心（有限合伙）出资人民币 10,526,842.58 元，占公司注册资本的 1.1696%；

上海聚信同赢企业管理中心（有限合伙）出资人民币 10,498,425.79 元，占公司注册资本的 1.1665%。

基金管理人无任何受处罚记录。

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

马宇晖先生，董事长，硕士。20 年证券相关从业经验。曾任宁波银行股份有限公司金融市场部产品开发副经理、经理，金融市场部总经理助理、副总经理、总经理，宁波银行副行长。现任永赢基金管理有限公司董事长，兼永赢资产管理有限公司董事长、永赢国际资产管理有限公司董事长。

章宁宁女士，副董事长，硕士。自 2007 年 7 月入职宁波银行股份有限公司，并自 2012 年 1 月起于宁波银行历任金融市场部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）、总经理，资金营运中心总经理，宁波银行副行长。现任永赢基金管理有限公司副董事长。

王丹丹女士，董事，硕士。曾任宁波银行股份有限公司金融市场部总经理助理、副总经理，资金营运中心副总经理、总经理。现任宁波银行股份有限公司副行长。

Tan Wing Ming（陈永明）先生，董事，硕士，新加坡籍。曾任 Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（新加坡华侨银行股份有限公司，简称新加坡华侨银行）东北亚区域总经理、香港分行行长、集团执行副总裁、大中华区代理总裁。现任新加坡华侨银行集团行政总裁顾问兼上海丽佳制版印刷有限公司董事。

Ang Eng Siong（洪湧翔）先生，董事，硕士，新加坡籍。曾任新加坡金融管理局经济学家；Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（新加坡华侨银行股份有限公司）财务部副总裁；华侨银行有限公司首席风险控制官、企业银行部总经理等。现任华侨银行有限公司首席执行官兼董事、华侨金信商业服务（深圳）有限公司非执行董事。

芦特尔先生，董事，硕士。23 年证券相关从业经验。曾任宁波银行股份有限公司金融市场部总经理助理、副总经理。现任永赢基金管理有限公司总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、永赢国际资产管理有限公司总经理兼董事。

陈巍女士，独立董事，硕士。曾任职于中国外运大连公司、美国飞驰集团无锡公司、北京市通商律师事务所，现任儒意电影娱乐股份有限公司董事、首席法律顾问。

胡建军先生，独立董事，硕士，中国注册会计师、中国注册资产评估师。现任上海市注册会计师协会理事，上海国家会计学院教育发展基金会理事，天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）管理合伙人、上海分所兼上海自贸试验区分所所长，云知声智能科技股份有限公司独立董事，纽氏达特行星传动系统技术（淄博）股份有限公司独立董事，华立科技股份有限公司独立董事。

王磊先生，独立董事，硕士。曾任职于北京市君合律师事务所、建银国际（上海）有限公司、通力律师事务所、锦天城律师事务所，现任北京市竞天公诚律师事务所上海分所合伙人、苏州智绿科技股份有限公司独立董事、北京泰岳宏达科技有限公司监事。

2、监事会成员

施道明先生，监事长，硕士，经济师。曾任宁波银监局主任科员、副处长；宁波银行股份有限公司零售公司部（小企业部）副总经理，上海分行行长，个人银行部、信用卡部总经理，首席风险经理，法律合规部总经理。现任宁波银行股份有限公司风险管理部总经理。

王妙如女士，监事，硕士。14 年证券相关从业经验。曾任安永华明会计师事务所高级审计员；国联安基金管理有限公司高级风控经理。现任永赢基金管理有限公司风险管理部总经理。

黄玉芳女士，监事，硕士。11 年证券相关从业经验。2015 年 7 月加入永赢基金管理有限公司，现任永赢基金管理有限公司合规部总经理。

3、管理层成员

芦特尔先生，硕士。23 年证券相关从业经验。曾任宁波银行股份有限公司金融市场部总经理助理、副总经理。现任永赢基金管理有限公司总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、永赢国际资产管理有限公司总经理兼董事。

汪成杰先生，硕士。13 年证券相关从业经验。曾任上海证监局副主任科员；陆家嘴金融城发展局证券机构服务办公室副主任；永赢基金管理有限公司合规部总监。现任永赢基金管理有限公司督察长，兼永赢资产管理有限公司监事、永赢国际资产管理有限公司董事。

厉大业先生，博士。19 年证券相关从业经验。曾任南京银行股份有限公司董事会办公室秘书、投资者关系管理负责人；鑫元基金管理有限公司董事会秘书、

产品总监。现任永赢基金管理有限公司首席产品官。

虞俏依女士，学士。22 年证券相关从业经验。曾任光大保德信基金管理有限公司运营部注册登记岗；诺德基金管理有限公司清算登记部总监；圆信永丰基金管理有限公司清算登记部总监；永赢基金管理有限公司基金运营部总经理兼人力资源部总经理。现任永赢基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，8年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。其在职期间管理基金的产品名称及管理时间如下表所示：

序号	产品名称	任职日期	离任日期
1	永赢创业板指数型发起式证券投资基金	2023-08-14	-
2	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2023-08-14	-
3	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金	2023-08-14	2025-05-08
4	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2023-08-14	2024-12-13
5	永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金	2023-10-24	-
6	永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2024-02-01	-
7	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	2024-11-08	2026-08-05
8	永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金	2025-01-02	-
9	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金	2025-01-24	2026-05-29
10	永赢国证商用卫星通信产业交易型开放式指数证券投资基金	2025-03-06	-
11	永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2025-03-11	-
12	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金	2025-05-09	2026-03-04
13	永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金	2025-06-25	-
14	永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2025-06-25	2026-08-28
15	永赢国证商用卫星通信产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2025-07-11	-
16	永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金	2025-07-23	-
17	永赢中证港股通央企红利指数型证券投资基金	2025-08-26	2025-09-10
18	永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2025-09-11	-
19	永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2025-09-16	-
20	永赢中证畜牧养殖产业交易型开放式指数证券投资基金	2026-02-04	-

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会由下述委员组成：总经理芦特尔先生、固定收益投资部总经理吴玮先生、首席权益投资官高楠先生、权益投资部总经理李文宾先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、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，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者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、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，不得将基金资产用于以下投资或活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

4、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。

5、法律法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受相关限制，且无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更。

6、基金经理承诺

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

（2）不利用基金财产或职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

（4）不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

（5）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。

1、控制环境

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

（1）公司引入了独立董事制度，目前有独立董事 3 名。董事会下设资格审查与薪酬委员会、风险管理委员会等专业委员会，其中风险管理委员会负责评价与完善公司内部控制体系。公司管理层设立了投资决策委员会、风险控制委员会、IT 治理委员会、产品委员会、估值委员会等专业委员会。

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

（3）公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的职业道德的培养，制定和颁布了《员工合规守则》，并进行持续教育。

2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。

风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

3、控制活动

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

（1）投资控制制度

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

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

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

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

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

（2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

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

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

（3）技术系统控制制度

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

（4）人力资源管理制度

公司建立了涵盖科学的招聘解聘、培训、考核、薪酬等内容的人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

（5）监察制度

公司设立了审计部，负责公司的监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

（6）反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构，指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作；各相关部门设立了反洗钱岗位，配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外，公司还制定了反洗钱内部控制制度及相关业务操作规程，确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4、信息沟通

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

5、内部监控

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

6、基金管理人关于内部控制的声明

（1）公司确知建立、实施和维持内部控制制度是公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：林静敏

联系电话：0755-88675313

2、平安银行基本情况

平安银行是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58%的股份，为平安银行的控股股东。截至 2025 年 12 月末，平安银行有 110 家分行（含香港分行）,共 1,108 家营业机构。

2025 年 1-12 月，平安银行实现营业收入 1,314.42 亿元（同比下降 10.4%）、净利润 426.33 亿元（同比下降 4.2%）、资产总额 59,257.77 亿元（较上年末增长 2.7%)、吸收存款本金余额 35,827.55 亿元（较上年末增长 1.4%)、发放贷款和垫款本金总额 33,908.40 亿元（较上年末增长 0.5%)。

3、主要人员情况

平安银行总行设资产托管部，下设银保信营销室、证券基金营销室、数字平台室、估值核算室、资金清算室、基金服务室、督察合规室、企划与综合服务室

8 个处室，目前部门人员为 75 人，为客户提供专业化的托管服务。证券投资基金托管业务相关员工配置齐全且从业经验丰富，资产托管部核心管理层具备银行管理、证券或托管业务十年以上从业经验。

4、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 15 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。截至 2025 年 12 月末，平安银行股份有限公司托管证券投资基金净值规模合计 8,995 亿，平安银行已托管 354 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求。

二、基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

2、内部控制组织结构

平安银行设有总行独立一级部门资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、销售机构

（一）直销机构

永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 27 层

法定代表人：马宇晖

联系电话：（021）5169 0103

传真：（021）6887 8782、6887 8773

联系人：施筱程

客服热线：400-805-8888

网址：www.maxwealthfund.com

（二）其他销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金。

基金销售机构的具体名单见基金管理人网站届时公示的销售机构名录，基金管理人可依据实际情况增减、变更基金销售机构，并在基金管理人网站披露最新的销售机构名单。

二、登记机构

名称：永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 27 层

法定代表人：马宇晖

联系电话：（021）5169 0188

传真：（021）5169 0179

联系人：曹婷

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张雯倩

四、审计基金财产的会计师事务所

名称: 容诚会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

办公地址: 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26

执行事务合伙人: 刘维、肖厚发

电话: 010-66001391

传真: 010-66001391

联系人: 陈逦迤

经办注册会计师: 陈熹、陈轶杰

第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

基金募集申请于 2026 年 8 月 28 日经中国证监会证监许可〔2026〕2322 号文准予募集注册。

一、基金名称

永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金

二、基金的类别

股票型证券投资基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

四、标的指数

本基金的标的指数为中证工业有色金属主题指数。

五、基金存续期限

不定期

六、募集对象和募集期

本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

募集期自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告及其他销售机构相关公告。

七、募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金管理人网站届时公示的基金销售机构名录。

具体销售机构联系方式以及发售方案以基金份额发售公告及基金管理人网站为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金份额发售公告》。

八、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

九、基金份额的类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，其中，通过直销机构认购/申购 A 类基金份额的不收取认购/申购费用。C 类基金份额为在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。其中，通过直销机构认购/申购 C 类基金份额的不收取销售服务费；通过其他销售机构认购/申购并持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，不再继续收取销售服务费。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值，各类别基金份额净值的计算公式为：计算日某类基金份额净值＝计算日该类别基金资产净值/计算日该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据基金销售情况，在不违反法律法规的规定、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致可以增加、减少或调整本基金的基金份额类别、或者对基金份额分类办法及规则进行调整、或者在法律法规和基金合同规定的范围内调整现有基金份额类别的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，基金管理人应依照《信息披露办法》的规定公告，不需召开基金份额持有人大会。

十、基金的面值、认购价格、计算公式和认购费用

1、本基金的基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

2、认购费用

本基金分为 A、C 两类基金份额，其中通过直销机构认购本基金 A 类基金份额不收取认购费用，通过其他销售机构认购的 A 类基金份额收取基金前端认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。

本基金采用金额认购方法，通过其他销售机构认购 A 类基金份额认购费率

按认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资者如果有多笔认购，适用费率按单笔 A 类基金份额认购分别计算。认购费不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售等募集期间发生的各项费用。

通过其他销售机构认购 A 类基金份额的具体认购费率如下：

单笔认购金额（含认购费）M	认购费率
M＜500 万元	0.30%
M≥500 万元	1000元/笔

3、认购份额的计算

本基金基金份额的初始面值均为1.00元。

（1）当投资者选择认购A类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

1）若投资者通过直销机构认购A类基金份额：

认购份额=（认购金额＋认购资金利息）/基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者通过直销机构投资10万元认购本基金A类基金份额，假设认购金额在募集期间产生的利息为50.00元，则其可得到的A类基金份额的份数计算如下：

认购份额=（100,000.00＋50.00）/1.00=100,050.00份

即：投资者通过直销机构投资10万元认购本基金A类基金份额，假设认购金额在募集期间产生的利息为50.00元，则其可得到100,050.00份A类基金份额。

2）若投资者通过其他销售机构认购A类基金份额：

①认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额＝认购金额/(1＋认购费率)

认购费用＝认购金额－净认购金额

认购份额＝（净认购金额＋认购资金利息）/1.00元

②认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用＝固定金额

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额+认购资金利息）/1.00元

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者通过其他销售机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，则其对应的认购费率为 0.30%，假设该笔认购资金产生的利息为 10.00 元，则其可得到的 A 类基金份额的份数计算如下：

净认购金额=10,000.00/(1+0.30%）=9,970.09 元

认购费用＝10,000.00－9,970.09=29.91 元

认购份额＝(9,970.09+10.00)/1.00=9,980.09 份

即，投资者通过其他销售机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，则其对应的认购费率为 0.30%，假设其认购资金的利息为 10.00 元，则其可得到 9,980.09 份 A 类基金份额。

例：某投资者通过其他销售机构投资 1,000 万元认购本基金 A 类基金份额，则其对应的认购费用为 1,000.00 元，假设该笔认购资金产生的利息为 550.00 元，则其可得到的 A 类基金份额的份数计算如下：

认购费用＝1,000.00 元

净认购金额＝10,000,000.00-1,000.00＝9,999,000.00 元

认购份额＝（9,999,000.00+550.00）/1.00＝9,999,550.00 份

即：投资人通过其他销售机构投资 1,000 万元认购本基金 A 类基金份额，则其对应的认购费用为 1,000.00 元，假设其认购资金的利息为 550.00 元，则其可得到 9,999,550.00 份 A 类基金份额。

（2）当投资者选择认购 C 类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

上述计算结果均保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 550 万元认购本基金 C 类基金份额，假设该笔认购资金产生的利息为 550.00 元，则其可得到的 C 类基金份额的份数计算如下：

认购份额＝（5,500,000.00+550.00）/1.00＝5,500,550.00 份

即：投资人投资 550 万元认购本基金 C 类基金份额，假设该笔认购资金产生的利息为 550.00 元，则其可得到 5,500,550.00 份 C 类基金份额。

十一、投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

2、认购方式

本基金认购采取金额认购的方式。

（1）投资人认购时，需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

（2）基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，通过其他销售机构认购 A 类基金份额的认购费用按每笔 A 类基金份额认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。

3、认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

4、认购限制

（1）投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

（2）在募集期内，投资人通过基金管理人的直销机构（线上直销渠道除外）认购，首次认购的单笔最低金额为人民币 10,000 元，追加认购的单笔最低金额为人民币 1,000 元；通过基金管理人线上直销渠道认购，首次认购的单笔最低金额为人民币 1 元，追加认购的单笔最低金额为人民币 1 元。通过基金管理人指定的其他销售机构认购，首次认购的单笔最低金额为人民币 1 元（含认购费），追加认购的单笔最低金额为人民币 1 元（含认购费）。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，但通常不得低于上述下限。

本基金对募集期间（指本基金募集完成进行验资时）的单个投资人的累计认购金额及持有基金份额比例限制详见相关公告。

基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整首次认购和追加认购本基金的最低金额、累计认购金额及持有基金份额比例限制。

（3）基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，通过其他销售机

构认购 A 类基金份额的认购费用按每笔 A 类基金份额认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。

（4）本基金可设置首次募集规模上限，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受首次募集规模的限制。

（5）如果本基金单一投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人有权对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理出资认购的不受上述限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认结果为准。

5、募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为相应类别的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。

十二、基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

十三、条件许可情况下的基金模式转换

若本基金管理人同时管理同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改基金合同，届时无需召开基金份额持有人大会。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或者基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资。基金管理人自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当于10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于6个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构见基金管理人网站届时公示的基金销售机构名录。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为相关证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日或遇港股通因其他原因暂停交易的情况，则本基金管理人有权决定是否暂停办理基金份额的申购、赎回或其他业务，并按规定进行公告），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现不可抗力，或者新的证券、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更、港股通交易规则变更、登记机构的业务规则变更、新的业务发展或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、

赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；

6、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；

7、认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起开始计算，申购的基金份额持有期限自登记机构注册登记系统确认之日起开始计算，至该部分基金份额赎回确认日止，且基金份额赎回确认日不计入持有期限。

基金管理人可在法律法规允许并在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对上述原则进行调整，或依据《业务规则》调整上述规则。基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项时，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金

管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的任何损失。

基金份额持有人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的基金份额余额，否则提交的赎回申请不成立。基金份额持有人提交赎回申请时，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人 T 日赎回申请生效后，基金管理人将在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、国家外汇管理局相关规定变更、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项划付时间相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、申购和赎回申请的确认

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

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果，由此产生的任何损失由投资人自行承担。

4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

在不违反法律法规和基金合同的前提下，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人将按照相关规定予以公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、申请申购基金的金额

投资人通过基金管理人的直销机构（线上直销渠道除外）申购，首次申购的单笔最低金额为人民币 10,000 元，追加申购的单笔最低金额为人民币 1,000 元；通过基金管理人线上直销渠道申购，首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元，追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元。通过基金管理人指定的其他销售机构申购，首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，但通常不得低于上述下限。基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整投资者首次申购和追加申购本基金的最低金额或累计申购金额及持有基金份额比例限制。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计申购金额及持有份额比例限制详见相关公告。基金管理人有权对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但本基金单一投资者（基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

2、申请赎回基金的份额

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔赎回不得少于 1 份（如该账户在该销售机构托管的基金余额不足 1 份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足 1 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。各销售机构对最低赎回限额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，但通常不得低于上述下限。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、单日累计申购金额/净申购金额上限、单个账户单日累计申购金额/净申购金额上限、单笔申购金额上限，具体规定请参见相关公告。

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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定见基金管理人相关公告。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的费用

1、申购费率

投资人通过直销机构申购本基金A类基金份额不收取申购费用，通过其他销售机构申购本基金A类基金份额时，需交纳申购费用，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资人申购C类基金份额不收取申购费用。投资者如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

通过其他销售机构申购A类基金份额的具体申购费率如下：

单笔申购金额（含申购费）M	申购费率
M＜500 万元	0.30%
M≥500万元	1000元/笔

本基金A类基金份额的申购费用主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费率

本基金对基金份额收取赎回费，A 类基金份额和 C 类基金份额适用相同的赎回费率，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相应基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金个人投资者的具体赎回费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7 日	1.50%
Y≥7 日	0

本基金除个人投资者以外的其他投资者的赎回费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7 日	1.50%

7 日≤Y＜30 日	1.00%
30 日≤Y＜180 日	0.50%
Y≥180 日	0

注：认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起开始计算，申购的基金份额持有期限自登记机构注册登记系统确认之日起开始计算，至该部分基金份额赎回确认日止，且基金份额赎回确认日不计入持有期限。

赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回相应类别基金份额时收取，并全额计入基金财产。如法律法规对赎回费的强制性规定发生变动，本基金将依新法规进行修改，不需召开基金份额持有人大会。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

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

6、法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

七、申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

（1）当投资者选择申购本基金的A类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

1）若投资者通过直销机构申购A类基金份额：

申购份额=申购金额/T日A类基金份额净值

申购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人通过直销机构投资100,000元申购本基金A类基金份额，假设申购当日本基金A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到的A类基金

份额申购份额为：

申购份额＝100,000/1.0500＝95,238.10份

即：投资人通过直销机构投资100,000元申购本基金A类基金份额，假设申购当日本基金A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到本基金A类基金份额95,238.10份。

2）若投资者通过其他销售机构申购A类基金份额：

①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额＝申购金额/(1＋申购费率)

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T日A类基金份额净值

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用＝固定金额

净申购金额=申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/T日A类基金份额净值

例：某投资者通过其他销售机构投资5万元申购本基金A类基金份额，则对应的申购费率为0.30%，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到的A类基金份额申购份额为：

净申购金额＝50,000.00/（1＋0.30%）＝49,850.45元

申购费用＝50,000.00－49,850.45＝149.55元

申购份额＝49,850.45/1.0500＝47,476.62份

即：投资者通过其他销售机构投资50,000.00元申购本基金A类基金份额，则对应的申购费率为0.30%，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到47,476.62份A类基金份额。

例：某投资者通过其他销售机构投资1,000万元申购本基金A类基金份额，则其对应的申购费用为1,000.00元，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到的A类基金份额的份数计算如下:

申购费用＝1,000.00元

净申购金额＝10,000,000.00-1,000.00＝9,999,000.00元

申购份额＝9,999,000.00/1.0500＝9,522,857.14份

即：投资人通过其他销售机构投资1,000万元申购本基金A类基金份额，则其对应的申购费用为1,000.00元，假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到9,522,857.14份A类基金份额。

（2）当投资者选择申购本基金的C类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额＝申购金额/T日C类基金份额净值

例：某投资者投资50,000.00元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则可得到的C类基金份额为：

申购份额=50,000.00/1.0500=47,619.05份

即：该投资者投资50,000元申购本基金C类基金份额，假设申购当日C类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则可得到47,619.05份C类基金份额。

（3）上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的相应类别基金份额净值为基准进行计算，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

（1）当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×T日对应类别基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用+应返还的销售服务费（如有）

其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的C类基金份额，计提的销售服务费（如有）将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的C类基金份额，持续持有期限超过一年继续计提到的销售服务费（如有）将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。

（2）上述计算结果均按四舍五入方法，保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某非个人投资者赎回10,000份本基金A类基金份额，该份额的持续持有期为5日，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日A类基金份额的基金份额净值

是1.2000元，则其可获得的赎回金额为：

赎回总额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝12,000.00×1.50%＝180.00元

赎回金额＝12,000.00－180.00＝11,820.00元

即：非个人投资者赎回10,000份本基金A类基金份额，该份额的持续持有期为5日，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日A类基金份额的基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为11,820.00元。

例：某个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过其他销售机构认购/申购获得），该份额的持续持有期为5日，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为：

赎回总额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝12,000.00×1.50%＝180.00元

赎回金额＝12,000.00－180.00＝11,820.00元

即：个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过其他销售机构认购/申购获得），该份额的持续持有期为5日，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为11,820.00元。

例：某非个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过直销机构认购/申购获得），假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，该份额的持续持有期为200日，对应的赎回费率为0，且假设该笔赎回确认应返还的销售服务费为25.00元（即通过直销机构认购/申购的C类基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还），其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝0.00元

赎回金额＝12,000.00－0.00+25.00＝12,025.00元

即：非个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过直销机构认购/申购获得），假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，该份额的持续持有期为200日，对应的赎回费率为0，且假设该笔赎回确认应返还的销售服务费为25.00元（即通过直销机构认购/申购的C类基金份额计提的销售服务费，在投

资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还），则其获得的赎回金额为12,025.00元。

例：某非个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过其他销售机构认购/申购获得），假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，该份额的持续持有期为730日，对应的赎回费率为0，且假设该笔赎回确认应返还的销售服务费为45.00元（即通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年的C类基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还），其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝0.00元

赎回金额＝12,000.00－0.00+45.00＝12,045.00元

即：非个人投资者赎回10,000份本基金C类基金份额（通过其他销售机构认购/申购获得），假设赎回当日C类基金份额的基金份额净值是1.2000元，该份额的持续持有期为730日，对应的赎回费率为0，且假设该笔赎回确认应返还的销售服务费为45.00元（即通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年的C类基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还），则其获得的赎回金额为12,045.00元。

3、基金份额净值计算

T日某类基金份额净值=T日该类基金份额的基金资产净值/T日的该类基金份额总数。

本基金分为A类基金份额和C类基金份额，各类基金份额单独设置代码，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定进行公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

八、申购与赎回的登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人 T 日申购基金成功后，基金登记机构在 T＋1 日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自 T＋2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人 T 日赎回基金成功后，基金登记机构在 T＋1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。

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

3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市或休市、港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益，或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

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

6、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（基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员除外）的持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 50%，或者通过一致行动人等方式变相使单一投资者持有本基金份额占本基金总份额的比例达到或超过 50%的情形时。

7、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

9、当日某笔申购申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日累计申购金额/净申购金额上限、本基金单日累计申购金额/净申购金额

上限、本基金总规模上限的，或接受该申购申请会使单个投资人累计持有的基金份额超出基金管理人公告的限额时。

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

11、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时。

12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、7、8、10、11、12 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 6、9 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市或休市、港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、若继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、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。

7、发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、支付结算机构或登记机构等的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金销售支付结算系统或基金会计系统无法正常运行。

9、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

10、出现基金管理人认为属于紧急事故的情况（包括但不限于占基金相当比例的投资品种因停牌或其他客观情况无法变现），导致基金管理人不能出售或评估基金资产。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

（3）若基金发生巨额赎回，基金管理人决定进行延期办理的情形下，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，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该类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。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。但是如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择“取消赎回”的，则其当日未获受理部分赎回申请将被撤销。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。而对该单个基金份额持有人当日未超过前述比例的赎回申请，基金管理人有权根据上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方

法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十三、基金转换

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

十四、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，履行相关程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请，并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。尽管有前述约定，基金销售机构仍有权决定是否办理基金份额的转托管业务。

十七、定期定额投资计划

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

十八、基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管部门另有规定的除外。

如相关法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人办理基金份额的质押业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

二十、其他业务

如相关法律法规允许，在履行相关程序后，基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生品（包括股指期货、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的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；每个交易日日终，在扣除衍生品合约投资需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内。

1、股票投资策略

通常情形下，本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌、退市或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行实时调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

（1）定期调整：根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

（2）不定期调整

①当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

②根据基金申购赎回情况，调整股票投资组合，以有效跟踪标的指数；

③根据法律法规规定，成份股在标的指数中的权重因其他原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当的调整，力争降低跟踪误差。

2、港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将重点关注：

①相对 A 股有稀缺性行业与个股，对资本有显著的吸引力，具有较高的配置价值；

②具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业具有良好成长性或高额股东回报率；

③盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司；

④相对 A 股同类公司具有显著的估值优势的公司。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

3、债券投资策略

（1）本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

（2）可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券投资策略

本基金将着重对可转债、可交债对应的基础股票的分析与研究，对有较好盈利能力或成长前景的上市公司进行重点选择，并在对应可转债、可交债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认投资机会。

4、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

5、衍生品投资策略

（1）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（2）国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货交易。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

（3）股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约进行投资。

6、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着审慎经营原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金基金份额持有人增厚投资收益。

7、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。本基金可根据投资策略需要或不同市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，

投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；

（2）每个交易日日终，在扣除衍生品合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；

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

（4）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

（4.1）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；

（4.2）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%；

（4.3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

（4.4）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；

（5）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%；

（6）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%；

（7）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

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

（9）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；

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

（11）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

（11.1）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%；

（11.2）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和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；

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

（11.4）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%；

（11.5）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（12）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

（12.1）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%；

（12.2）基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

（12.3）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%；

（12.4）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和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；

（12.5）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；

（13）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：

（13.1）基金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%；

（13.2）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

（13.3）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；

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

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

（16）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（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；

（18）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述（2）、（4）、（9）、（14）、（15）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或基金合同另有约定除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

3、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。

4、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受相关限制，且无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更。

五、标的指数

本基金的标的指数为中证工业有色金属主题指数。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会，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。

标的指数成份股发生明显负面事件面临退市等风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

若出现指数更名等对基金投资无实质性影响的标的指数变更情形，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在规定媒介上公告。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证工业有色金属主题指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%

1、业绩比较基准设定的原因

本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。本基金的标的指数为中证工业有色金属主题指数，本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%，本基金主要采用完全复制法进行投资，相应选取中证工业有色金属主题指数收益率作为股票资产的基准要素，权重设置为 95%。同时本基金基于流动性管理需求选取活期存款基准利率作为流动性资产的基准要素，权重设置为 5%。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径

中证工业有色金属主题指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 H11059，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。如果活期存款基准利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中中证工业有色金属主题指数、活期存款基准利率的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。

4、基金管理人管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌、退市或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行实时调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围的，本基金将采取合理措施避免跟踪误差过大。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

本基金的业绩比较基准股票部分与标的指数一致，相关变更情形和程序详见基金合同“基金的投资”章节“五、标的指数”部分内容。若本基金调整业绩比较基准的要素权重，本基金将根据法律法规、中国证监会的规定和基金合同约定履行相关程序。

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准相应调整，由基金管理人根据标的指数变更情形履行适当程序后，在规定媒介进行公告。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

七、风险收益特征

本基金是股票型证券投资基金，理论上预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，理论上具有与标的指数，以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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、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；

2、有利于基金财产的安全与增值；

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

4、不谋求对上市公司的控股。

九、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见 “侧袋机制”章节的规定。

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、期货合约、票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十一部分 基金资产估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

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

三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

四、估值方法

1、上市有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，但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）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日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进行估值；

（3）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日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进行估值。

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，同时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；

（4）对于在交易所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。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

（3）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，应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；

（4）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、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。

4、期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、本基金投资的股票期权合约，根据相关法律法规和监管部门的规定估值。

6、本基金参与融资及转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

8、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或其他可以反映公允价值的汇率为准。

9、对于按照中国法律法规和基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

10、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，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

11、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。

12、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。

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

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

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

五、估值程序

1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，由此产生的误差计入基金财产。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。法律法规、监管机构、基金合同或会计准则等另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应于每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按照规定对外公布。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或证券经纪机构、

或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由此而造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

（5）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）当估值错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；当估值错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当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、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值

计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同约定估值方法的第 11 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记结算机构、证券经纪机构、第三方估值机构、指数编制机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或未能避免错误发生或虽发现错误但因上述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十、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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

第十二部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况对本基金进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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；

3、本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经履行适当程序，基金管理人可调整基金收益的有关业务规则，并及时公告。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、C 类基金份额的销售服务费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费等费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货、股票期权交易、结算费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

H＝E×0.50%÷当年实际天数

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，按月支付。经由基金托管人与基金管理人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年实际天数

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，按月支付。经由基金托管人与基金管理人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

3、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，仅就 C 类基金份额收取销售服务费。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的 0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年实际天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的基金销售服务费每日计提。

（1）直销机构的销售服务费的返还机制

对于通过直销机构认购/申购该类基金份额收取的销售服务费，待投资者赎回基金份额或基金合同终止时，该费用将随同赎回款或清算款一并返还给投资者。

（2）其他销售机构的销售服务费的收取与返还机制

对于投资者持续持有期限未超过一年（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。经基金管理人与基金托管人确认后，由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，由基金管理人支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，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收取的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，该费用随赎回款或清算款一并返还给投资者。

上述“一、基金费用的种类”中第 4－11 项费用，根据有关法规及相应协议

规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

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；

4、基金的标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；

5、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、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或相关公告。

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。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。对于基金份额持有人必须自行缴纳的税收，由基金份额持有人自行负责，基金管理人和基金托管人不承担代扣代缴或纳税的义务。

第十四部分 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；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

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双方认可的方式确认。

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、符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

第十五部分 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》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）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、法人或非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

（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，并在基金份额发售的三日前登载在规定媒介上。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载基金合同生效公告。

（四）各类基金份额的基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

（五）各类基金份额申购、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各类基金份额申购、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三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决

策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（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依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

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、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

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

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

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、销售服务费、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、任一类基金份额净值估值错误达该类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、基金推出新业务或服务；

22、增加、减少或调整本基金份额类别设置；

23、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定或基金合同约定的其他事项。

（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。

（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，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（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。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定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

将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（十一）投资股指期货、国债期货的信息披露

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

（十二）投资股票期权的信息披露

本基金可投资股票期权，基金管理人按照相关法律法规要求进行披露。

（十三）投资资产支持证券的信息披露

本基金可投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十四）参与融资及转融通证券出借业务的信息披露

本基金可参与融资及转融通证券出借业务，基金管理人按照相关法律法规要求进行披露。

（十五）投资存托凭证的信息披露

本基金可投资存托凭证，本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

（十六）投资港股通标的股票的信息披露

本基金可投资港股通标的股票，基金管理人应当在基金年度报告、中期报告、季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（十七）实施侧袋机制期间的信息披露

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、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书"侧袋机制"章节的规定。

（十八）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规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。

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，供社会公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况之一时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露相关的基金信息：

1、不可抗力；

2、发生基金合同约定的暂停估值的情形；

3、法律法规、中国证监会规定或基金合同认定的其他情形。

第十六部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金服务机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

（一）基金份额的申购与赎回

1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。基金管理人应依法向投资者进行充分披露。

（二）基金的投资

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（三）基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。

基金管理人可以将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

（四）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

（五）基金的信息披露

1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

2、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：报告期内的特定资产处置进展情况；特定资产可变现净值或净值区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺。

3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人将在每次处置变现后按规定及时发布临时公告。

（六）特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋账户资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户对应的基金份额持有人支付已变现部分对应的款项。

（七）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十七部分 风险提示

一、投资于本基金的主要风险

（一）市场风险

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

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

资本市场是国民经济的重要组成部分，在宏观经济运行中发挥着重要的功能。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济增长具有周期性特征。对经济增长和经济周期的预期变化，以及宏观经济运行的实际状况将对证券市场的资产价值产生重要影响，从而对基金投资形成风险。

3、利率风险

利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

4、购买力风险

购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响。

6、债券回购风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用

风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

7、上市公司经营风险

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

（二）信用风险

信用风险主要指债券发行人因经营情况恶化等因素发生违约，或债券发行人拒绝履行还本付息义务，或由于债券发行人或债券本身信用等级降低导致债券价格波动等风险。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。

（三）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。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使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

本基金申购、赎回安排详见本招募说明书“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/期货交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，投资范围为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券和货币市场工具等），并以标的指数的成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象，标的指数成份股在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。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部分赎回申请的措施。详见本招募说明书“基金份额的申购与赎回”章节。

（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赎回需求的情形时，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、摆动定价、实施侧袋机制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。

① 延期办理巨额赎回申请

具体请参见基金合同“基金份额的申购与赎回”章节，详细了解本基金延期办理巨额赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人面临无法全部赎回或无法及时获得赎回资金的风险。在本基金暂停或延期办理投资者赎回申请的情况下，投资者未能赎回的基金份额还将面临净值波动的风险。

② 暂停接受赎回申请

具体请参见基金合同“基金份额的申购与赎回” 章节，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，若本基金暂停接受赎回申请，投资人在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。

③ 延缓支付赎回款项

具体请参见基金合同“基金份额的申购与赎回” 章节，详细了解本基金延缓

支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，若本基金延缓支付赎回款项，赎回款支付时间将后延，可能影响投资人的资金安排。

④收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者，应当收取 1.5%的赎回费，该赎回费全额计入基金财产。

因此，短期赎回费的收取将使得持续持有期少于 7 日的投资者将承担较高的赎回费。

⑤暂停基金估值

具体请参见基金合同“基金资产估值”章节，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

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

⑥摆动定价

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

在此情形下，当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

⑦启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

（四）管理风险

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

等因素影响基金收益水平。

（五）操作风险

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。

（六）合规性风险

基金管理或运作过程中，因违反国家法律、法规、监管部门的规定以及基金合同有关规定而给基金财产带来损失的风险。

（七）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。

销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与本基金风险之间的匹配检验。

（八）本基金特有的风险

1、标的指数的风险

标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

2、标的指数波动的风险

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

3、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与

整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

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

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

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

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

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6、标的指数变更的风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合随之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

7、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，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，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。

8、成份股停牌或退市的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌或退市，发生成份股停牌或退市时，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。

9、港股通标的股票的投资风险

（1）本基金可通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1）港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股估价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；

2）只有内地、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常

交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

3）出现规定的情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4）投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易服务公司另有规定的除外；因港股通股票发行人供股、股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利凭证在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

5）代理投票。由于中国结算是在汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

（3）汇率风险

本基金可投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国结算进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

（4）港股交易失败风险

港股通业务期间存在每日额度限制。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入

交易的风险。

（5）本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

10、本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

11、股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

国债期货是一种金融合约。投资于国债期货需承受市场风险、基差风险、流动性风险等。国债期货采用保证金交易制度，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部

初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险，可能给投资带来重大损失。

12、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；（2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

13、参与融资交易的风险

本基金通过融资交易可以扩大交易额度，利用较少资本来获取较大利润，这必然也放大了风险。本基金将所持股票作为担保品进行融资时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担新投资股票带来的风险，还得支付相应的利息或费用，如判断失误或操作不当，会加大亏损，本基金投资者需承担由此导致的风险。

14、存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。本基金可根据投资策略需要或不同市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。

15、本基金可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险、政策风险等。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金投资科创板股票的风险包括但不限于：

（1）科创板企业退市风险

科创板退市制度较主板更为严格且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板股票进入退市流程，将面临退出难度较大、成本

较高的风险。

（2）市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域，大多数企业为初创型公司，上市门槛略低于 A 股其他板块，企业未来盈利、现金流、估值等均存在不确定性，个股投资风险加大。此外，科创板企业普遍具有前景不确定、业绩波动大、风险高的特征，市场可比公司较少，估值与发行定价难度较大。同时，科创板竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%）、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

（3）流动性风险

科创板投资门槛较高，由此可能导致整体流动性相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

（4）监管规则变化的风险

科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，导致基金投资运作产生相应调整变化。

16、若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回份额的风险。

17、基金运作方式、投资模式变更的风险

若本基金管理人同时管理同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会。

投资者还有可能面临运作方式、投资模式变更、《基金合同》相应修改的风险。

18、销售服务费计提与返还机制的相关风险

（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费按日计提，但对于投资人通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额收取的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应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（详见基金合同“基金费用与税收”章节），因此，C 类基金份额的销售服务费率水平需结合投资者的购买渠道以及 C 类基金份额持有期限确定。

（2）由于本基金在计算 C 类基金份额净值时，已按基金合同约定或另行公告的销售服务费年费率计提销售服务费，该计提金额可能高于投资者最终实际承担的销售服务费。在 C 类基金份额赎回或基金合同终止的情形发生时，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与按披露的 C 类基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

（九）其他风险

1、技术风险

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

2、法律风险

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

3、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，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

二、声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还可通过基金管理人指定的其他销售机构进行销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

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、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但遇基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的情形时，清算期限可相应顺延。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配，分配金额需加上返还基金份额持有人的销售服务费（如有）。

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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

第十九部分 基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一） 基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

（12）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；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；

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

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为

基金提供服务的外部机构；

（16）在不违反有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金份额转让、定期定额投资计划和非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算各类基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告各类基金份额的基金净值信息，确定各类基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人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；

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

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

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

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

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人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）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户、为基金办理场外证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、各类基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

（19）因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任

不因其退任而免除；

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金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。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务

包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；

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

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

（10）提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实、准确、完整；

（11）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组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

（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，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费，但法律法规要求调整报酬标准或销售服务费的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人或基金托管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）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规和基金合同规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）增加、减少或调整本基金的基金份额类别，对基金份额分类办法及规则进行调整，调整申购费率、调低销售服务费率，变更收费方式，或停止现有基金份额类别的销售；

（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）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构，调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资计划等业务规则；

（6）基金管理人在履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

（7）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见，基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符

合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权他人代为出席基金份额持有人大会并行使表决权，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名

（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，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自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

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

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若

相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监

管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但遇基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的情形时，清算期限可相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配，分配金额需加上返还基金份额持有人的销售服务费（如有）。

（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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存时间不低于法律法规

规定的最低期限。

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，可通过友好协商解决。如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

基金合同受中华人民共和国法律（为基金合同之目的，在此不包括中国香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第二十部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 21、22、23、27 层

法定代表人：马宇晖

设立日期：2013 年 11 月 7 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证监许可[2013]1280 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：玖亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-51690188

（二）基金托管人

名称：平安银行股份有限公司

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复 1987【365】号

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系电话：0755-88675313

经营范围：办理人民币存、贷、结算、汇兑业务；人民币票据承兑和贴现；

各项信托业务；经监管机构批准发行或买卖人民币有价证券；外汇存款、汇款；境内境外借款；在境内境外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据的承兑和贴现；外汇放款；代客买卖外汇及外币有价证券，自营外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；保险兼业代理业务；黄金进口业务；经有关监管机构批准或允许的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生品（包括股指期货、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的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；每个交易日日终，在扣除衍生品合约投资需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行

适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；

（2）每个交易日日终，在扣除衍生品合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；

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

（4）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

（4.1）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；

（4.2）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%；

（4.3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

（4.4）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；

（5）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%；

（6）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%；

（7）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（8）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%；

（9）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；

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

（11）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

（11.1）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%；

（11.2）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和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；

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

（11.4）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%；

（11.5）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（12）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

（12.1）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%；

（12.2）基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

（12.3）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%；

（12.4）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和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；

（12.5）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；

（13）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：

（13.1）基金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%；

（13.2）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

（13.3）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；

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

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

（16）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（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；

（18）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述（2）、（4）、（9）、（14）、（15）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或基金合同另有约定除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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。

根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，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、与本机构有其他重大利害关系的关联方名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联方名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。基金托管人的关联方名单以其对外公开披露的信息为准。

（四）法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受相关限制，且无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更。

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

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责处理因交易对手不履行合同而造成的纠纷，基金托管人不承担由此造成的相应法律责任及损失。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人。如基金管理人未提供名单，视为可与全市场交易对手进行交易。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资中期票据进行监督。

（七）基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，完善业务流程，有效防范和控制风险，基金托管人将对基金参与转融通证券出借业务进行监督和复核。

（八）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供存款银行名单的，视为基金管理人认可所有存款银行。基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并通知基金管理人。

（九）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金产品资料概要、基金清算报告、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。

（十）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项

进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

（十二）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担，基金托管人在履行其通知义务后，予以免责。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（十三）基金托管人在投资监督过程中应当审慎履职，在能力范围内采取必要合理措施，对信息的真实性、准确性等进行评估。

如基金托管人发现托管产品违反法律法规或合同约定进行投资的，应当拒绝执行；按照交易程序已经达成交易的或无法拒绝执行的，应当及时提示基金管理人等相关方；发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）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、证券账户和期货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的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以电话提醒或书

面提示等方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给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。基金托管人应就基金管理人合理的疑义进行解释或举证。

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经营机构的固有财产。

2. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3. 基金托管人按照规定开设/协助开设基金财产的资金账户、证券账户和期货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，分账管理，独立核算，确保基金财产的完整与独立。

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

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人已履行通知义务的，对此不承担相应责任，但应当提供必要的协助。

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

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人或其委托的登记机构在具有托管资格的商业银行开立的基金募集专户。该账户由基金管理人或其委托的登记机构开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，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》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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，基金托管人应提供充分协助。

（三）基金银行账户（亦称“托管账户”）的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2. 基金托管人根据有关规定以本基金的名义在其营业机构开立银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金管理人授权基金托管人办理本基金银行账户的开立、销户、变更工作，本基金银行账户无需预留印鉴，具体按基金托管人要求办理。基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户、证券资金账户和期货账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

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

3. 基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户，并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协

议。

4. 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经营机构负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

5. 基金托管人与基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货账户。

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

（五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司根据有关规定以本基金的名义为基金开立债券托管账户，并代表本基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表

基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同，基金管理人应尽量保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限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加盖授权业务章的合同传真件或复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 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。

各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，由此产生的误差计入基金财产。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。法律法规、监管机构、基金合同或会计准则等另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2. 复核程序

基金管理人应于每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按照规定对外公布。

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

基金托管人应当根据约定的方法和《企业会计准则》的规定复核基金管理人提供的托管产品财务数据，发现错误的应当及时提示基金管理人。可以从第三方渠道获取可靠数据的，基金托管人应当主要使用第三方数据进行会计核算，但基

金托管人对第三方渠道的数据和信息的真实性、准确性、有效性和完整性不作任何担保、承诺、暗示或表示、不承担相应责任，并对第三方渠道提供的信息和数据的错误和遗漏所引起的损失不承担相应责任。对仅依赖基金管理人提供且无法从其他渠道获取可靠数据进行会计核算所造成的估值错误，基金托管人不承担责任。

（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、银行存款本息、应收款项、资产支持证券、期货合约、股票期权合约和其它投资等资产及负债。

2. 估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（1）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

3. 估值方法

（1）上市有价证券的估值

1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，但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）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日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进行估值；

3）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日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进行估值。

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，同时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；

4）对于在交易所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。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

3）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，应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；

4）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）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。

（4）期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

（5）本基金投资的股票期权合约，根据相关法律法规和监管部门的规定估值。

（6）本基金参与融资及转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

（7）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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

（8）港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或其他可以反映公允价值的汇率为准。

（9）对于按照中国法律法规和基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

（10）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，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

（11）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。

（12）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。

（13）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，

按国家最新规定估值。

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

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

4. 特殊情形的处理

（1）基金管理人或基金托管人按基金合同约定估值方法的第（11）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记结算机构、证券经纪机构、第三方估值机构、指数编制机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或未能避免错误发生或虽发现错误但因上述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

5. 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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

（三）估值错误的处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当本基金任一类别基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

本托管协议的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或证券经纪机构、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人

遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由此而造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

（5）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）当估值错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；当估值错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（四）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当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、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）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。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。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。

（七）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

（1）报表的编制

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规定网站上，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规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招募说明书、基金产品资料概要。

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

（2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

七、争议解决方式

双方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受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、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。

（二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；

2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

如基金管理人存在拒不履行托管协议、被依法取消业务资格、被依法解散撤销等情形的，基金托管人可根据规定，采取有关措施保护财产安全，并及时告知相关方。在采取必要、合理措施保障投资者合法权益的前提下，基金托管人有权终止托管服务。

（三）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组

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

2) 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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。

2. 基金财产清算程序

1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3）对基金财产进行估值和变现；

4）制作清算报告；

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

6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

7）对基金剩余财产进行分配。

3. 基金财产清算的期限为 6 个月，但遇基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的情形时，清算期限可相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配，分配金额需加上返还基金份额持有人的销售服务费（如有）。

（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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报

中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）开户及交易

投资者可以通过以下方式进行有关的开户、交易业务：

1、 在基金管理人的直销网点进行网上或柜台交易。

2、在基金管理人指定的其他销售渠道进行网上或柜台交易。

（二）账户信息查询服务

投资者可以通过以下方式进行自助查询及人工咨询：

1、登录基金管理人网站或微信服务号。基金份额持有人可以查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等。

2、致电客服热线暨自动语音查询系统（400-805-8888），该系统提供全天候的7×24 小时自动查询服务和周一至周五上午09:00-11:30，下午13:00-17:30（非交易日除外）的人工咨询服务。

3、发送邮件到服务信箱（service@maxwealthfund.com）。

4、基金管理人的直销网点和指定的其他销售渠道为投资人提供各类查询服务。

（三）对账单订阅服务

1、投资者可以通过拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的电子对账单。

2、投资者可以通过拨打客服热线获取纸质对账单。

（四）邮件订阅服务

投资者可拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的电子邮件服务。内容包括基金净值、交易确认及相关基金资讯信息等。

（五）短信订阅服务

投资者可拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的手机短信服务。内容

包括基金净值、交易确认及相关基金资讯信息等。

（六）客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过客服热线、信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

（七）投资者交流活动

基金管理人将定期或不定期举办专业研讨会、投资者见面会或其他形式的交流活动，为投资者提供与基金管理人进行直接交流的机会。

客服热线：400-805-8888（该电话可转人工服务）

传 真：(021) 6887 8782、6887 8773

公司网址：http://www.maxwealthfund.com

服务信箱：service@maxwealthfund.com

第二十二部分 其他应披露事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

第二十三部分 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书分别存放在基金管理人、基金托管人的住所，投资者可在办公时间免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站www.maxwealthfund.com进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十四部分 备查文件

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

1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；

2、《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金基金合同》；

3、《永赢中证工业有色金属主题指数型证券投资基金托管协议》；

4、律师事务所出具的本基金申请注册的法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其它文件。

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：投资者可在办公时间免费查阅。

永赢基金管理有限公司

2026年9月