

# 兴银基金管理有限责任公司

## 兴银中证港股通科技交易型开放式指数 证券投资基金招募说明书

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇二二年十月

## 重要提示

兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 2021 年 5 月 18 日证监许可〔2021〕1766 号注册。

兴银基金管理有限责任公司(以下称“本基金管理人”或“管理人”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册。中国证监会对基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础,以充分的信息披露和投资者适当性为核心,以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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、成份券停牌等潜在风险。

本基金主要投资于中证港股通科技指数的成份股和备选成份股,其投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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,投资者在投资本基金前,请认真阅读基金合同、本招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:本基金特有风险、市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险及其他风险等。本基金特有风险包括:标的指数的风险(包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险等)、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、组合证券的变现风险、退补现金替代方式的风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、退市风险、第三方机构服务的风险、投资特定品种(包括股指期货、股票期权等金融衍生品、资产支持证券)的特有风险、

参与融资与转融通证券出借业务的风险等。

本基金参与内地与香港股票市场交易互联互通机制下港股通相关业务，基金资产投资于港股，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（在内地开市港股休市的情形下，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，具体详见本招募说明书的“风险揭示”章节。

本基金投资范围包括股指期货、股票期权等金融衍生品，股指期货、股票期权等金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货或期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

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。

在现有结算规则下，当日申购的基金份额，T 日交收成功后，T+1 日可卖出或赎回。为投资者办理申购赎回业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记机构关于 ETF 的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关专业知识和清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额等相关的交收方式及业务规则已经认可。

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户，但需注意：使用基金账户只能参与本基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应使用 A 股账户。

本基金的标的指数为中证港股通科技指数。

### 一、指数样本空间

以中证港股通综合指数样本为样本空间

### 二、选样方法

(1) 对样本空间内的证券，剔除过去一年日均成交金额不足 1000 万港元的证券；

(2) 在剩余证券中，选取通信、互联网、医疗器械、生物科技、电子、半导体、新能源等行业的上市公司证券作为科技主题空间；

(3) 在科技主题空间中，剔除过去两年营业收入增速连续为负以及过去两年研发投入占营业收入的比例不足 3% 的证券，对各中证二级行业市值排名前三的证券豁免上述要求；

(4) 在剩余证券中，按照过去一年日均按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取靠排名靠前的 50 只证券作为指数样本，不足 50 只时，全部纳入。

### 三、成份股计算方法

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum$  (证券价格  $\times$  调整股本数  $\times$  权重因子  $\times$  汇率)，汇率、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 10%。

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

基金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，本基金管理人不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或高于或低于投资人先前所支付的对价，如对本招募说明书有任何疑问，应

寻求独立及专业的财务意见。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

## 目 录

第一部分	绪言	7
第二部分	释义	8
第三部分	基金管理人	14
第四部分	基金托管人	21
第五部分	相关服务机构	25
第六部分	基金的募集	27
第七部分	基金合同的生效	32
第八部分	基金份额折算与变更登记	34
第九部分	基金份额的上市交易	35
第十部分	基金份额的申购与赎回	37
第十一部分	基金的投资	50
第十二部分	基金的财产	57
第十三部分	基金资产的估值	58
第十四部分	基金的收益与分配	64
第十五部分	基金费用与税收	66
第十六部分	基金的会计与审计	68
第十七部分	基金的信息披露	69
第十八部分	风险揭示	76
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	86
第二十部分	基金合同内容摘要	89
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要	106
第二十二部分	对基金份额持有人的服务	120
第二十三部分	其他应披露事项	122
第二十四部分	招募说明书存放及查阅方式	123
第二十五部分	备查文件	124

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）等其他有关法律法规以及《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指兴银基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《兴银中证港股通科技交易型开放式指数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《兴银中证港股通科技交易型开放式指数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《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及更新
- 7、基金产品资料概要：指《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及更新
- 8、基金份额发售公告：指《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、基金份额上市交易公告书：指《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》
- 10、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
- 11、《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
- 12、《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

13、《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

14、《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

15、《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

16、《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

17、ETF：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”

18、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

21、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

22、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

23、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

24、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

25、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

26、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》所定义的机构投资者

27、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

28、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转托管等业务

29、销售机构：指兴银基金管理有限责任公司以及符合《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

30、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的在募集期间代理本基金发售业务的机构

31、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

32、登记结算业务：指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（及其不时修订）定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

33、登记机构：指办理本基金登记业务的机构。本基金的登记机构为兴银基金管理有限责任公司或接受兴银基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构，本基金场内申赎、交易的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

34、基金账户：指登记机构为投资者开立的、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

35、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

36、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

37、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

38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、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

41、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42、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（本基金的开放日为港股通、深圳证券交易所、上海证券交易所同时正常开放交易的工作日）

43、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

44、《业务规则》：指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、兴银基金管理有限责任公司、基金销售机构发布及其不时修订的相关规则 and 规定

45、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

46、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规定申请购买基金份额的行为

47、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转换为基金合同规定的赎回对价的行为

48、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

49、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

50、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

51、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

52、标的指数：本基金标的指数为中证港股通科技指数，及其未来可能发生的变更

53、现金替代：指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金

54、**现金差额**：指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

55、**基金份额参考净值**：指基金管理人或者基金管理人委托的机构在交易时间内，根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

56、**预估现金部分**：指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结

57、**最小申购赎回单位**：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍

58、**基金份额折算**：指基金管理人根据基金合同规定，在不改变投资者权益的前提下调整投资者的基金份额及基金份额净值的行为

59、**元**：指人民币元

60、**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

61、**收益评价日**：指基金管理人计算累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之日

62、**基金累计报酬率**：收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日计算）

63、**标的指数同期累计报酬率**：收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日计算）

64、**基金资产总值**：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

65、**基金资产净值**：指基金资产总值减去基金负债后的价值

66、**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

67、**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

68、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

69、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，通过内地与香港股票市场交易互联互通机制买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

70、转融通证券出借业务：是指本基金以一定的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（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融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

71、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

72、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、概况

名称：兴银基金管理有限责任公司

住所：平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房

办公地址：中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层

法定代表人：张贵云

设立时间：2013 年 10 月 25 日

客服电话：40000-96326

传真：021-68630069

注册资本：人民币 1.43 亿元

联系人：林娱庭

本公司经证监会证监许可〔2013〕1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

张贵云先生，本科，经济师。历任中农信厦门证券营业部员工，福建华福证券厦门营业部总经理助理，广发华福证券龙岩营业部总经理，华福证券厦门湖滨南营业部总经理，华福证券厦门分公司党委书记、总经理，华福证券总裁助理兼福州分公司党委书记、总经理，兴银基金总经理。现任华福证券党委委员、副总裁，兼任兴银基金党委书记、董事长，上海兴瀚资产管理有限公司执行董事。

赵建兴先生，本科学历、硕士学位。历任天津通信广播公司软件工程师，光宝电子(天津)有限公司软件工程师，北京长天集团项目经理，长城基金信息技术部总经理、电子商务部总经理，宝盈基金信息技术部总经理、电子商务部总经理，长城基金总经理助理、副总经理、首席信息官兼信息技术部总经理、电子商务部

总经理。现任兴银基金董事、党委副书记、总经理，兼任首席信息官及代为履行督察长职务。

陈维先生，博士研究生。曾任国泰君安证券研究所证券分析师，现任国脉科技董事长、福建国脉集团有限公司董事、慧翰微电子股份有限公司董事、兴银基金董事。

胡平西先生，硕士研究生。历任中国人民银行漠河县支行办事员、副股长；中国人民银行漠河县支行副行长；中国人民银行浙江鄞县支行信贷股副股长；中国人民银行宁波中心支行信贷科副科长；中国人民银行宁波市分行副行长；中国人民银行浙江省行人事处长、外汇管理处长；中国人民银行浙江省分行纪委书记、副行长；中国人民银行福建省分行行长、党委书记、外汇管理局长；中国人民银行武汉大区分行行长、党委书记（管辖湖北、湖南、江西三省），外管局武汉分局局长；中国人民银行上海大区分行行长、党委书记（管辖上海市、浙江省、福建省），外管局上海分局局长；上海农村商业银行董事长、党委书记。现任宁波银行独立董事、厦门农村商业银行独立董事、兴银基金独立董事。

叶少琴女士，博士研究生。曾兼任厦门大学会计师事务所和厦门永大会计师事务所注册会计师。现任厦门大学管理学院会计系教授、兴银基金独立董事。

潘越女士，博士研究生。历任厦门大学经济学院金融系讲师、硕士生导师、副教授。现任厦门大学经济学院金融系教授、博士生导师，兴银基金独立董事。

## 2、监事会成员

吴真子女士，硕士研究生。历任厦门市证券监督管理委员会办公室文秘、办公室副主任、副秘书长、证管处副处长，中国证监会厦门特派办综合处副处长、机构监管处副处长、上市公司监管处副处长，中国证监会厦门监管局上市公司监管处副处长、处长、办公室主任、机构监管处处长、办公室主任兼党办主任，长城国瑞证券有限公司党委委员、监事会主席，兴银基金督察长。现任兴银基金党委副书记、纪委书记、监事会主席、工会主席。

游小芳女士，硕士研究生。历任中国电信福州分公司人力资源部人力资源岗，华福证券人力资源部人力资源岗，华福证券福州分公司综合部副总经理、综合部总经理兼党委办公室主任，现任兴银基金党委办公室主任、办公室总经理兼人力资源部总经理、职工监事。

陈晖先生，硕士研究生。历任华福证券厦门湖滨南路营业部投资经理、融资

融券部交易盯市岗、固定收益部交易员，兴银基金运营保障部下辖中央交易室副总经理、交易部总经理助理（指定负责人）、副总经理（主持工作），现任兴银基金职工监事、合规与风险管理部副总经理。

### 3、高级管理人员

赵建兴先生，总经理，兼任首席信息官及代为履行督察长职务。（简历见上述董事会成员介绍）

洪木妹女士，硕士研究生。历任华福证券投资自营部、资产管理总部研究员/投资主办、华福基金投资管理部副总经理。现任兴银基金党委委员、副总经理，兼任固定收益部总经理及固定收益部下设二级部门公募投资部负责人。

沈阳女士，本科学历，硕士学位。历任广发证券深圳业务总部分析师，中国证券报记者，恒生投资管理有限公司深圳代表处市场研究员，博时基金南方大区区域经理、机构理财总经理，浙商基金副总经理，长城基金副总经理。现任兴银基金党委委员、副总经理，兼任渠道与客服部总经理。

刘钊先生，博士研究生。历任华福证券研究规划部研究员，华福基金（现更名为兴银基金）研究发展部研究员，华福证券党委办公室机要秘书、主任助理、副主任，办公室总经理助理、副总经理，办公室发展规划部副总经理（主持工作）、总经理。现任兴银基金党委委员、副总经理。

郑翊鸣先生，本科。历任天宇电气总账会计，华福证券自营部办事员、台江/杨桥/下藤营业部财务经理、财务部业务主办、达道/东大营业部财务经理、稽核部现场稽核、福州闽清营业部总经理、湖南长沙营业部总经理、福州连江营业部总经理，现任兴银基金财务总监兼计划财务部总经理。

### 4、基金经理

李哲通，硕士研究生，拥有 12 年证券、基金行业工作经验。曾任巴克莱资本利率衍生品分析师，深圳大岩资本量化投资副总裁，上海迈维资产执行总经理。2020 年 10 月加入兴银基金，现任兴银基金指数与量化投资部基金经理。自 2021 年 3 月 1 日起担任兴银中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。自 2022 年 1 月 26 日起担任兴银中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

刘帆，南开大学金融工程硕士，FRM（金融风险管理师），6 年基金行业工作经验，曾任平安基金管理有限公司中央交易室交易员、ETF 指数投资中心研究员兼基金经理助理。2020 年 11 月加入兴银基金，现任兴银基金指数与量化投资部



基金经理。自 2021 年 7 月 14 日起任兴银中证科创创业 50 指数型证券投资基金的基金经理，自 2021 年 8 月 6 日起任兴银国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

公司总经理兼首席信息官及代为履行督察长职务赵建兴、研究发展部总经理兼协助管理权益投资部王丝语、指数与量化投资部总经理陈龙、资产配置部副总经理（主持工作）袁作栋、基金经理王卫。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同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、赎回对价；按规定受理申购、赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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 15 年以上；

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、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺：

(1) 严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他法律法规行为的发生；

(2) 根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

2、基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定，基金资产不得用于下列投资或者活动：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产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、行政法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺：

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### (一) 内部控制制度概述

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制

组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、业绩评估考核制度、交易工作管理制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统运行管理制度、保密管理制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

## （二）内部控制的原则

### 1、健全性原则

内部控制包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和全体人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

### 2、有效性原则

通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

### 3、独立性原则

基金管理人设立独立的督察长与监察稽核部门，并保持高度的独立性与权威性；基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立；公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

### 4、相互制约原则

基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

### 5、成本效益原则

基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## （三）内部控制的组织体系

基金管理人的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层、操作层的全面监督和控制。具体而言，包括以下组成部分：

1、**董事会**：董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，对公司全体人员和业务监督控制。

2、**监事会**：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

3、**督察长**：督察长对董事会直接负责。负责公司的监察与稽核工作，对公

公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向董事会和中国证监会报告。

4、风险控制委员会：风险控制委员会是为加强公司在业务运作过程中的风险控制而成立的专门委员会之一，向公司总经理负责，协助公司总经理制定风险控制政策，识别和评估各类重大风险，组织实施风险应对方案，并就公司风险管理情况定期或不定期（如遇特殊事件）向董事会合规及风险管理委员会汇报工作。

5、合规与风险管理部：合规与风险管理部负责对公司内部控制制度的执行情况进行合规性监督检查，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行，定期出具监察稽核报告提交全体董事审阅并报送中国证监会。

6、各业务部门：内部控制是每一个业务部门和员工最首要和基本的职责。各部门的负责人在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各位员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

#### （四）基金管理人关于内部控制制度声明书

1、基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

2、基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2021 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 8.60 万亿元，实现营业收入 2212.36 亿元，同比增长 8.91%，全年实现归属于母公司股东的净利润 826.80 亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

### 二、托管业务部部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字〔2005〕74 号。截至 2022 年 6 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 581 只，托管基金的基金资产净值合计 23576.61 亿元，基金份额合计 22676.87 亿份。

### 四、托管业务的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，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。

#### 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照本行相关制度对本行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

#### 3、内部控制原则

(1) 全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

(2) 重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

(3) 独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

(4) 审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

(5) 制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

(6) 适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经

营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

(7) 成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

## 五、内部控制制度及措施

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

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

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

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

## 六、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

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

金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、发售协调人

具体名单详见基金份额发售公告。

#### 2、网下现金发售直销机构

兴银基金管理有限责任公司

注册地址：平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房

办公地址：中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢三层、五层

法定代表人：张贵云

联系人：林娱庭

联系电话：021-20296260

传真：021-68630069

公司网站：[www.hffunds.cn](http://www.hffunds.cn)

#### 3、其他销售机构

网下现金发售代理机构和网上现金发售代理机构具体名单详见本基金基金份额发售公告。

4、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：冯天骄

电话：021-38874800-8283

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系人：丁媛

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

### 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼

法定代表人：邹俊

联系电话：(021) 2212 2888

传真：(021) 6288 1889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、欧梦激

## 第六部分 基金的募集

本基金依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》等有关法律法规及《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，经 2021 年 5 月 18 日中国证监会证监许可〔2021〕1766 号文件注册。

### 一、基金类别、运作方式和存续期间

基金类别：股票型证券投资基金、指数基金

基金运作方式：交易型开放式

存续期间：不定期

### 二、募集方式和募集场所

本基金通过基金份额发售机构向投资者公开发售。

投资者可选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在本基金基金份额发售公告中列明。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。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。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。

### 三、募集期限

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。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

#### 四、募集对象

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。

#### 五、基金份额发售面值、认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

#### 六、认购安排

##### 1、认购开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所A 股账户或基金账户。

(1) 如投资者需新开立证券账户，则应注意：

①基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易；如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应开立A 股账户。

②开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2 个工作日办理开户手续。

(2) 如投资者已开立证券账户，则应注意：

① 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

##### 2、认购费用

投资人认购本基金需要缴纳认购费，认购费率如下表：

认购份额	认购费率
M<50 万份	0.8%
50 万份≤M<100 万份	0.5%
M≥100 万份	1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用；投资者申请多次现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。发售代理机

构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构按照不高于 0.8% 的标准收取一定的费用。

## 七、网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购金额的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算公式为：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例一：某投资者到某发售代理机构网点认购10,000份本基金基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.80%，则需准备的认购资金金额计算如下：

认购佣金=1.00×10,000×0.80%=80.00元

认购金额=1.00×10,000×(1+0.80%)=10,080.00元

即该投资者若通过该发售机构认购本基金10,000份，需准备10,080.00元资金，一共可以得到10,000份基金份额。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍。最高不得超过99,999,000份。投资者应以上海证券账户认购，可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询

认购确认情况。

## 八、网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额发售面值

例二：某投资者到本公司直销网点认购 100,000 份本基金基金份额，假设认购资金募集期间产生的利息为 2.00 元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

认购费用=1.00×100,000×0.80%=800.00 元

认购金额=1.00×100,000×（1+0.80%）=100,800.00 元

利息折算份额=2.00/1.00=2 份

即投资者通过本公司直销网点认购本基金 100,000 份，需准备 100,800.00 元资金，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 100,002 份基金份额。

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收：T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理

人于 T+1 日进行有效认购款项的清算交收。发售期结束后，基金管理人将于第 4 个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金募集专户。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 个工作日将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

### **九、募集资金利息的处理方式**

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

### **十、募集资金的保管与费用**

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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效的条件

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，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 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金的退还工作。
- 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，基金管理人应当在 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进行表决。



法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额折算与变更登记

### 一、基金份额折算的时间

基金合同生效后，基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。本基金进行基金份额折算的，基金管理人确定基金份额折算日，并提前公告。

### 二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排请详见届时披露的份额折算公告。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除因尾数处理外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### 三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

四、如未来本基金增加基金份额的类别，基金管理人在实施份额折算时，可对全部份额类别进行折算，也可根据需要只对其中部分类别的份额进行折算。如本基金对部分份额类别进行折算，对于涉及投票权、提议召集权、召集权、计算到会或出具表决意见的持有人所代表的基金份额数量、表决权、基金财产清算等需要统计基金份额持有人所持份额及其占总份额比例时，每一份未折算的基金份额与固定比例的已折算基金份额代表同等权利，其中固定比例指折算比例。

## 第九部分 基金份额的上市交易

### 一、基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

- 1、基金场内募集金额不低于 2 亿元；
- 2、基金场内份额持有人不少于 1,000 人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

### 二、基金份额的上市交易

基金份额在上海证券交易所的上市交易、停复牌、终止上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### 三、终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易：

- 1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定提前终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，届时基金管理人可变更本基金的登记机构、申购与赎回的安排等条款并根据变更为非上市指数基金的情况相应调整基金合同，而无需召开基金份额持有人大会审议。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合

并或者选取其他合适的指数作为标的指数。

四、基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单，本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算，并通过上海证券交易所发布，仅供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值的计算公式如下：

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须现金替代的替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分)/最小申购、赎回单位对应的基金份额（最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格）。

汇率公允价包括中证指数有限公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格等。

基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。

基金管理人经与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以调整基金份额参考净值计算方法，并予以公告。

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

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

七、在不违反法律法规的规定及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他交易场所上市交易，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十部分 基金份额的申购与赎回

基金合同生效后，本基金采用现金申购赎回方式，即全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。未来在上海证券交易所和登记机构系统允许的情况下，基金管理人可决定增加本基金组合证券的申购赎回方式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，并在实施前依照有关规定在规定媒介上予以公告，无需召开基金份额持有人大会。

### 一、申购与赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。基金管理人将在开放申购、赎回业务之前公告申购赎回代理券商的名单。基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理券商。

在未来条件允许的情况下，基金管理人直销可以开通申购赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。

在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要，在履行适当程序后，向本基金的联接基金和基金管理人认可的投资者开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算。

### 二、申购与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，具体办理时间为港股通、上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办

理时间在申购开始公告中规定。

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赎回开始公告中规定。

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或者赎回。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，申请上市期间基金可暂停办理申购、赎回业务。

### 三、申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券（如系统支持）、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定。
- 5、本基金申购、赎回的币种为人民币；基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增加其他币种的申购、赎回，其他币种申购、赎回的具体规则届时将另行公告；
- 6、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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的方式，在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时，必须根据当日申购赎回清单备足申购对价，否则所提交的申购申请无效。

投资者在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的赎回申请无效。

## 2、申购和赎回申请的确认

投资者提交的申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据申购赎回清单要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

申购赎回代理券商受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。投资者应及时查询有关申请的确认情况。

## 3、申购与赎回的清算交收

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券（如系统支持）、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。

本基金现金申购业务中的现金替代采用逐笔全额结算处理；现金赎回业务中的现金替代采用代收代付处理；现金申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付处理；申购、赎回业务后续若涉及到组合证券，则组合证券的清算交收按照上海证券交易所、登记机构的相关业务规则执行。

投资人 T 日提交的申购申请受理后，由登记机构在 T 日为投资人办理基金份额、现金替代的清算和交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理机构和基金托管人。基金管理人在 T+1 日办理现金差额的清算，在 T+2 日通过登记机构代收代付平台办理现金差额的交收。

投资人 T 日提交的赎回申请受理后，由登记机构在 T 日为投资人办理基金份额的清算和交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理机构和基金托管人。基金管理人在 T+1 日办理现金差额的清算，在 T+2 日通过登记结算机构代收代付平台办理现金差额的交收。赎回现金替代金额的清算交收由基金管理人和申购赎回代理机构协商处理。正常情况下，赎回现金替代金额的清算交收于 T+7 日（指开放日）内办理，但如果出现基金投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因暂停交易、流动性不足等原因

导致无法足额卖出，或港股通每日额度、国家外汇管理相关规定的限制等情况，则该款项的清算交收可延迟办理。

申购赎回涉及的现金差额、现金替代应退款项、赎回现金替代款涉及交收日为港股通交易日和交收日的交集（不含半日港股通交易日或未完成两批次资金交收之日），当交收期间出现港股通交易日为非港股通交收日时，款项交收日期顺延。

投资者应按照基金合同的约定和销售机构的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额或现金替代补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

基金管理人和登记机构可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质性利益的前提下，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、参与本基金的日常申购、赎回，需按最小申购、赎回单位的整数倍提交申请。本基金目前的最小申购赎回单位为 100 万份基金份额。

基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资人需求，在法律法规允许的情况下，调整最小申购、赎回单位。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、基金管理人可以规定本基金当日申购及赎回总规模的上限，具体规定请参见相关公告。

3、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份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。具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购份额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购时应交付的组合证券（如系统支持）、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回时，基金管理人应交付给投资人的组合证券（如系统支持）、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

4、投资者在申购或赎回时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

基金管理人可以在不违反相关法律法规且不影响基金份额持有人实质性利益的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

## 七、份额申购赎回清单的内容与格式

### 1、申购赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

### 2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金。

现金替代分为两种类型：退补现金替代（标志为“退补”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

退补现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券允许使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

#### （1）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或法律法规限制投资的证券；或基金管理人出于保护基金份额持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其调整后 T 日开盘参考价按照 T-1 日估值汇率换算或基金管理人认为合理的其他方法。

#### （2）退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券是指基金管理人认为需要在投资者申购或赎回时代投资者买入或卖出的证券

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券调整后 T 日开盘参考价 × T-1 日估值汇率 × (1 + 现金替代溢价比例)；

收取现金替代溢价的原因是，基金管理人需要在收到申购确认信息后，在香港市场购入组合证券，实际结算成本与替代金额可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的替代金额高于购入该部分证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的替代金额低于购入该部分证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

### ③申购替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日申购申请，T 日内基金管理人根据申购规模进行组合证券的代理买入，通常情况下代理买入在 T 日接近收盘时点完成。T 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用，折算为人民币）和未买入的被替代证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代金额确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。T 日后的第 2 个工作日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理买入及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

### ④赎回替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请，T 日内基金管理人根据赎回规模进行组合证券的代理卖出，通常情况下代理卖出在 T 日接近收盘时点完成。T 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的 T 日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；被替代证券 T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。T 日后的第 2 个港股通交收日后的第 2 个工作日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇港股通临时停市等特殊情况，组合证券的代理卖出及结算价格可依次顺

延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。

⑤基金管理人可根据运作情况调整代理申赎投资者买券卖券的相关规则并按规定公告。

⑥未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或上海证券交易所、登记机构有关申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对上述相关现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。

#### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指，为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金部分，其计算公式为：

$T$  日预估现金部分 =  $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与该证券调整后  $T$  日开盘参考价以及  $T-1$  日估值汇率相乘之和)

其中，该证券调整后  $T$  日开盘参考价主要根据指数服务机构提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

如果  $T-1$  日至  $T$  日期间有香港联合交易所交易日非申赎开放日，则基金管理人可对公式中“ $T-1$  日最小申购赎回单位的基金资产净值”进行调整。

#### 5、现金差额相关内容

$T$  日现金差额在  $T+1$  日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

$T$  日现金差额 =  $T$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - (申购、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价以及  $T$  日估值汇率相乘之和)

T 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

## 6、申购赎回清单的格式

图表：T 日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息					
最新公告日期		XXXX 年 XX 月 XX 日			
基金名称		兴银中证港股通科技交易型开放式指数 证券投资基金			
基金公司名称		兴银基金管理有限责任公司			
一级市场基金代码		XXXXXX			
T-1 日信息内容					
现金差额（单位：元）		XX.XX 元			
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）		XX.XX 元			
基金份额净值（单位：元）		X.XXXX 元			
T 日信息内容					
最小申购、赎回单位的预估现金部分（单位：元）		XX.XX 元			
现金替代比例上限		XX%			
申购上限		无			
赎回上限		无			
最小申购赎回单位（单位：份）		XXXX 份			
是否需要公布 IOPV		是			
申购赎回的允许情况		申购赎回皆允许			
T 日成份股信息内容					
股票代码	股票简称	股票数量（股）	现金替代标志	现金替代	固定替代金额（单

				溢价比率	位：人民币元)

## 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市或港股通临时停市或遇公共节假日，可能影响本基金的投资运作，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、港股通每日额度已满使基金管理人无法找到合适的代替投资品种的情况下，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 6、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购份额上限，如果一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申购份额超过申购赎回清单中规定的申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝。
- 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，或证券市场价格发生大幅波动，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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 9、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误。
- 10、因相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者因指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。
- 11、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、7、8、9、10、11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。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。

### 九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能受理或办理基金份额持有人的赎回申请或不能支付赎回对价。

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对价。

3、证券/期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或港股通临时停市，或遇公共节假日，可能影响本基金投资运作，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误。

5、因相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者因指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

7、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对价或暂停接受基金赎回申请。

8、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回份额上限，如果一笔新的赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝。

9、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、5、6、7、9 项情形之一且基金管理人决定暂停基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回对价时，基金管理人应在网站及其他媒介上刊登暂停公告并在当日报中国证监会备案。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、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介刊登重新开放申购或赎回的公告；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。

#### 十一、其他申购赎回方式

1、对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

3、ETF 联接基金是指其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出 ETF 联接基金，ETF 联接基金可以在本基金基金合同生效后、用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

5、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

条件允许时，在不违反法律法规规定且对基金份额持有人无实质性不利影响



的前提下，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前予以公告。

6、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

## **十二、基金的非交易过户**

基金登记机构可根据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并按照规定收取一定的手续费用。

## **十三、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。

**十四、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，根据市场情况对上述申购与赎回的安排进行补充和调整并提前公告。**

## 第十一部分 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。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好的实现基金的投资目标，本基金可能少量投资于国内依法发行上市的非成份股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、其他港股通标的股票、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）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。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。

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：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### 三、投资策略

本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近

目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

### 1、资产配置策略

本基金管理人完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 2、债券投资策略

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。

### 3、股指期货投资策略

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货等与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易，从而更好地跟踪标的指数。

### 4、资产支持证券投资策略

产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

### 5、融资及转融通投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。

本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 6、股票期权投资策略

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。

### 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) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 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%；
- (3) 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%；
- (4) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (7) 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；
- (8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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%；

② 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值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；

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

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

⑥ 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

(10) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

① 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 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；

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 30%；

③ 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按市值加权平均计算；

④ 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元。

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

(12) 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方开展逆回购交易的，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；

(13) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

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

(15) 本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

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%；

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；

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；

(16) 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。

本基金参与转融通证券出借业务，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第（10）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

除上述（6）、（7）、（11）、（12）项外，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、港股通额度不足等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证港股通科技指数收益率。

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

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

## 六、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表

现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金可投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### **七、基金的融资和转融通证券出借业务**

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。本基金开展融资和转融通证券出借业务之前，基金管理人将根据法律法规、政策、指引等有关规定制定融资业务和转融通证券出借业务方案，经与基金托管人协商一致，履行适当程序后提前在规定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

### **八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法**

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。



## 第十二部分 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证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分 基金资产的估值

### 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、债券、资产支持证券、银行存款本息、股指期货合约、股票期权合约、应收款项、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、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股

票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

#### 4、股指期货合约、股票期权合约的估值方法

股指期货合约、股票期权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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

5、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

6、基金参与转融通证券出借业务的，应参照法律法规和中国证券投资基金业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、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。

### 2、估值错误处理原则

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

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，

并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

## 八、基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依照《信息披露办法》等相关规定以及《基金合同》约定对基金净值予以公布。

## 九、特殊情形的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；
- 2、由于证券/期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误或不可抗力等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益分配原则

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配采用现金分红；
- 3、每一基金份额享有同等分配权；
- 4、基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率（经汇率调整）达到 1% 以上，方可对超额收益进行分配；
- 5、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
- 6、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，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

### 二、基金收益分配数额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率（经汇率调整）。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率 = 基金累计报酬率 - 标的指数同期累计报酬率（经汇率调整）

- 2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的份额可分配收益，并确定收益分配比例。
- 3、每基金份额的应分配收益为份额可分配收益乘以收益分配比例，保留小数点后 3 位，第 4 位舍去。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的基金超额收益、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 四、收益分配方案的确定、公告与实施



本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

#### 五、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。

## 第十五部分 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货/期权交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费及年费、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 9、基金的账户开户费用、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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，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：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

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、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、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。

## 第十六部分 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书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《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在2日内在规定媒介公告。

## 第十七部分 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等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人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、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）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；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；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和《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，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

## （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）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将基金份额上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

## （五）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并提前将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

## （六）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基金份额净值和基金份额累计净值。

## （七）基金份额申购、赎回清单公告

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点公告当日的申购赎回清单。

## （八）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。

#### （九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在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、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、本基金停复牌或终止上市；

21、本基金推出新业务或服务；

22、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

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

#### （十）澄清公告

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

#### （十一）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。

## （十二）投资资产支持证券信息披露

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

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

## （十三）投资股指期货信息披露

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

## （十四）融资及转融通证券出借业务的信息披露

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

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等文件中披露基金参与转融通证券出借交易的情况，并就报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

## （十五）投资港股通标的股票的相关公告

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

## （十六）投资股票期权信息披露

本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定投资政策和投资目标。

## （十七）中国证监会规定的其他信息。

## 六、暂停或延迟信息披露的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业

时；

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

3、发生基金合同约定的暂停估值的情形；

4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

## 七、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、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披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在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和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为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，法律法规另有规定的从其规定。

## 八、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和基金上市交易的证券交易所网站，供社会公众查阅、复制。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的风险

本基金属于股票型基金，适合能正确认识和对待本基金可能出现的投资风险的投资人。本基金投资过程中面临的主要风险有：市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、其他风险及本基金的特定风险。

#### 1、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，产生风险，主要包括：

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

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

**利率风险：**金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

**上市公司经营风险：**上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。

#### 2、流动性风险

##### （1）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为指数型基金，跟踪的标的指数为中证港股通科技指数，主要投资港股通范围内 50 只市值较大、研发投入较高且营收增速较好的科技龙头上市公司证券，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。因此，本基金面临的流动性风险主要来自跟踪指数的成份股和备选成份股因重大事项等原因引起的停牌。在某些市场环境下，成份股中停牌股票的比例可能比较大。

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构

建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。标的指数成份股权重分布较均衡，集中度较低，且成份股均属于流动性较好，交易较活跃的股票。在特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，以满足基金流动性需求。此外，在基金投资运作中，基金管理人严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，充分做好开放式基金流动性风险的管理工作。

#### （2）本基金的申购、赎回安排

详见本招募说明书“第十部分基金份额的申购与赎回”。

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

基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

本基金备用流动性风险管理工具包括暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值及中国证监会认定的其他措施，投资者将面临其赎回申请被拒绝、赎回对价延缓支付等的风险。

### 3、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合同进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

### 4、管理风险

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

### 5、本基金的特有风险

#### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### （2）标的指数波动的风险

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

### （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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

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，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

③标的指数成份股派发现金红利将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

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

⑤由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，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在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

⑦其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；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。

### （4）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

### （5）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将年跟踪误差控制在4%以内，但因标的指数编制规则调整或其

他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### （6）指数编制机构停止服务的风险

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

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，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。

#### （7）成份股停牌的风险

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

- 1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。
- 2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。
- 3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、份额申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。
- 4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分ETF份额的风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照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，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

#### （8）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### （9）参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

上海证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

#### （10）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### （11）投资者申购失败的风险

基金管理人有权根据本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的申购申请，从而导致申购失败。

#### （12）投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### （13）组合证券的变现风险

在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致组合证券变现后的价值与赎回时组合证券的价值有差异，存在变现风险。

#### （14）退补现金替代方式的风险

本基金在申购赎回环节新增了“退补现金替代”方式，该方式不同于现有



其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

#### （15）套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和ETF存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

#### （16）申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。

#### （17）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

①申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

②登记机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

③第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

#### （18）本基金投资特定品种的特有风险

①本基金投资范围包括股指期货、股票期权等金融衍生品，股指期货、股票期权等金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货或

期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

②本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

#### （19）基金参与融资与转融通业务的风险

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

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：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。

#### （20）投资于香港证券市场的特有风险

本基金可以投资港股通标的股票所带来的特有风险，包括但不限于：

##### 1）海外市场风险

本基金在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

##### 2）股价波动较大的风险

港股市场实行T+0回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比A股更为剧烈的股价波动，本基金的波动风险可能相对较大。

##### 3）汇率风险

本基金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，中国证券登记结算有限责任公司

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，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

#### 4) 港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，发生拒绝或暂停申购，暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形，可能影响投资人的申购以及份额持有人的赎回。

#### 5) 港股通可投资标的的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入。以上情形可能对本基金带来不利影响。

#### 6) 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而影响基金的申购赎回安排。

#### 7) 交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出资金回到本基金人民币账户的周期比内地证券市场要长。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

#### 8) 港股通标的的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持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交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得

的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；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联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### 9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及\*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### 10) 港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

### 6、其他风险

#### (1) 技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### (2) 操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，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，交易错误，会计部门欺诈。

#### (3) 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。

#### （4）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二、声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益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。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，根据自身的投资目的、风险承受能力、投资期限、投资经验、资产状况等对是否投资本基金做出独立决策。

本基金投资中的风险包括市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、本基金的特有风险、其他风险等。本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金通过基金销售机构销售，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。

## 第十九部分 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，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后 2 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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 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财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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不低于法律法规规定的最低期限。



## 第二十部分 基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利与义务

#### (一) 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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或申购对价及法律法规和《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，并保证其真实性；

(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、法规及中国证监会规定，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、法规规定，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结算业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资和参与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) 在符合有关法律、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基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

- (10) 编制季度报告、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，向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (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、足额支付赎回对价；
- (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，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (24) 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。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财

产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；

(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对价；

(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。

## 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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：

鉴于本基金和本基金联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金联接基金的基金份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和计票时，本基金联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，本基金联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金联接基金份额占本基金联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

本基金联接基金的基金管理人不应以本基金联接基金的名义代表本基金联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金联接基金的特定基金份额持有人的委托以本基金联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金联接基金的基金管理人代表本基金联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照本基金联接基金基金合同的约定召开本基金联接基金的基金份额持有人大会，本基金联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由本基金联接基金的基金管理人代表本基金联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独

或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外：

- （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；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）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）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- （14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对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）履行适当程序后，调整本基金的申购费率，调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；
- （3）因相应的法律法规、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《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、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、转托管等业务规则；

(6) 履行适当程序后，推出新业务或服务；

(7) 基金管理人调整基金收益分配原则；

(8) 履行适当程序后，调整基金的申购赎回方式；

(9) 履行适当程序后，调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率，调整申购冲击成本率或赎回冲击成本率；

(10) 履行适当程序后，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、调整申购赎回方式；

(11) 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、通讯开会方式或法律法规、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三分之一以上(含三分之一)基金份额的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可通过网络、电话或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方式开会的程序进行;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、在法律法规和监管机构允许的情况下,基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用纸质、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 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。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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。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) 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,基金管理人经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、基金合同解除和终止的事由、程序

#### (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,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后2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、《基金合同》约定的其他情形;
- 4、出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的;
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### (三)基金财产的清算

- 1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内

成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(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财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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，如经友好协商、调解未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本合同之目的，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。

**五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

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

## 第二十一部分 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：兴银基金管理有限责任公司

注册地址：平潭综合实验区金井湾商务营运中心 6 号楼 11 层 03-3 房

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号 N1 座 3 层、5 层

邮政编码：200120

法定代表人：张贵云

成立日期：2013-10-25

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2013〕1289 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.43 亿元

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：350013

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复〔1988〕347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字〔2005〕74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 207.74 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售

汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好的实现基金的投资目标，本基金可能少量投资于国内依法发行上市的非成份股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、其他港股通标的股票、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）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。

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。

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：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### （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) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 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%；
- (3) 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%；
- (4) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (7) 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；
- (8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (9) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：
  - 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%；
  - ② 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值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；
  - ③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；
  - ④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

⑥本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（10）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 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；

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 30%；

③证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按市值加权平均计算；

④最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元。

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

（12）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方开展逆回购交易的，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；

（13）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

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

（15）本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

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%；

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；

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；

（16）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。

本基金参与转融通证券出借业务，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第（10）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

除上述（6）、（7）、（11）、（12）项外，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、港股通额度不足等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提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。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对

手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人有权向相关交易对手追偿，基金托管人应予以必要的协助与配合。基金托管人根据银行间债券市场成交单对本基金银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。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，基金托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒基金管理人，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。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。

#### （五）基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。基金管理人应当按照有关法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关相关法规及协议对基金银行存款业务进行监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金投资银行存款的，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，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。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银行。

基金管理人对于定期存款提前支取的损失由其承担。

（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，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

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

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度并提交给基金托管人。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在相关制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件(如有)：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

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

6、基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。

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



7、相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(七)基金托管人依据有关法律法规的规定、基金合同和本托管协议的约定对于基金关联交易进行监督。

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，应当符合本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的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人及基金托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人及基金托管人应及时发送另一方，另一方于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。一方收到另一方书面确认后，新的关联交易名单开始生效。

(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，对基金资产净值计算、基金份额净值计算(根据基金信息披露方式选择)、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(九)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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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）基金管理人有关义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。

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

（十一）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，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人，由此造成的相应损失由基金管理人承担。

（十二）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产保管

##### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的  
其他账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人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。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令,不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用)。
- 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,基金托管人应予以必要的协助与配合,但对此不承担相应责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (二) 基金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开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- 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》、基金合同等有关规定后，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，未能达到基金备案的条件，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）基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人为本基金单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本基金名称，具体名称以实际开立为准。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，均需通过该托管资金账户进行。。

2、托管资金账户的开立和使用，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、托管资金账户的管理应符合有关法律法规的规定。

### （四）定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中应当有如下明确意思表示的条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述明确意思表示条款，基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，基金托管人保管证实书正本。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

### （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，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户、资金结算账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与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、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### （七）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人协商一致后开立。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。

#### （八）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上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限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。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

的资产不承担保管责任。

#### （九）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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金净值的计算、复核的时间和程序

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是指基金资产净值除以计算日基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2、复核程序

基金管理人每个估值日对基金资产进行估值，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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果以双方约定的方式提交给基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人根据基金净值信息的计算结果对外予以公布。

### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

## 七、基金托管协议的变更与终止

### （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。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

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

## 八、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 第二十二部分 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。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### 一、基金份额持有人登记服务

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

### 二、定期定额投资计划

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

### 三、持有人交易记录查询及邮寄服务

#### 1、基金交易确认服务

基金投资人在交易申请被受理的 2 个工作日后,可以到销售网点查询和打印该项交易的确认信息,或者通过基金公司客服电话及网站进行查询。

#### 2、定期对账单邮寄服务

基金交易对账单分为季度对账单和年度对账单,记录该基金份额持有人最近一季或一年内所有申购、赎回等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。季度对账单在每季结束后的 20 个工作日内向有交易的基金份额持有人以书面或电子邮件形式寄送,年度对账单在每年度结束后 20 个工作日内对所有基金份额持有人以书面或电子邮件形式寄送。

#### 3、基金份额持有人交易记录查询服务



本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心（包括电话呼叫中心和网站账户自动查询系统）和本基金管理人的销售网点查询历史交易记录。

#### 四、投诉受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网站在线客服、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和其他销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过其他销售机构的服务电话进行投诉。

#### 五、服务联系方式

##### 1、客户服务中心

客服电话：40000-96326。

传真：021-68630069

##### 2、互联网网站

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

电子信箱：[services@hffunds.cn](mailto:services@hffunds.cn)

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

## 第二十三部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的的内容与格式进行披露，并在规定媒介上公告。

## 第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，分别存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

(一) 中国证监会准予兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金注册的文件

(二) 《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《兴银中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查询；也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

兴银基金管理有限责任公司

2022年10月18日