

华安中证全指证券公司指数分级  
证券投资基金  
更新的招募说明书

**(2020 年第 1 号)**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二〇年三月

## 重要提示

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会2015年5月14日证监许可[2015]911号文注册。本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过指定媒介进行了公开披露。本基金的基金合同自2015年6月9日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

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，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险（如指数化投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额配对转换业务及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等）和投资股指期货的风险。

基金资产投资于科创板股票，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，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，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。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并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投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现（或“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人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见基金管理人网站公示名单。

本基金以1.00元发售面值开展基金募集，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于发售面值。

本招募说明书中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。本次招募说明书仅根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》、《托管协议》，对所涉章节进行了更新，相关信息更新截止日为2020年2月28日。除特别说明外，本招募说明书其他所载内容截止日为2019年6月9日，有关财务数据截止日为2019年3月31日，净值表现截止日为2018年12月31日。

## 目 录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                  | 1   |
| 二、释义 .....                  | 2   |
| 三、基金管理人 .....               | 8   |
| 四、基金托管人 .....               | 18  |
| 五、相关服务机构 .....              | 22  |
| 六、基金份额的分级与净值计算规则.....       | 36  |
| 七、基金的募集 .....               | 40  |
| 八、基金合同的生效 .....             | 41  |
| 九、基金份额的上市交易.....            | 42  |
| 十、基金份额的申购与赎回.....           | 44  |
| 十一、基金份额的登记、转托管及其他业务.....    | 54  |
| 十二、基金份额的配对转换.....           | 56  |
| 十三、基金的投资 .....              | 58  |
| 十四、基金的业绩 .....              | 68  |
| 十五、基金的财产 .....              | 69  |
| 十六、基金资产的估值.....             | 70  |
| 十七、基金的收益与分配.....            | 75  |
| 十八、基金的费用与税收.....            | 76  |
| 十九、基金份额折算 .....             | 79  |
| 二十、基金的会计与审计.....            | 88  |
| 二十一、基金的信息披露.....            | 89  |
| 二十二、风险揭示 .....              | 96  |
| 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 105 |
| 二十四、基金合同的内容摘要.....          | 107 |
| 二十五、基金托管协议的内容摘要.....        | 108 |
| 二十六、对基金投资人的服务.....          | 109 |
| 二十七、其他应披露事项.....            | 111 |
| 二十八、招募说明书存放及查阅方式.....       | 115 |
| 二十九、备查文件 .....              | 116 |

|                   |     |
|-------------------|-----|
| 附件一：基金合同内容摘要..... | 117 |
| 附件二：托管协议内容摘要..... | 132 |

## 一、绪言

《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《华安中证全指证券公司指数分级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。投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

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：指华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指华安基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华安中证全指证券公司指数分级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《华安中证全指证券公司指数分级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《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、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
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《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《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
- 12、《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
- 13、《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
- 14、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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、投资人或投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构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

22、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

23、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、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指华安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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、会员单位：指具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

26、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

27、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，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、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户等

29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为华安基金管理

有限公司或接受华安基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

30、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

31、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统

32、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

33、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

34、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。投资人办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

35、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认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

36、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

37、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

38、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

39、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

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

42、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

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

44、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

45、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

46、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金

登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订，以及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

47、标的指数：指中证全指证券公司指数

48、华安中证证券份额：指华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额

49、华安中证证券 A 份额：指华安中证全指证券公司份额按基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额

50、华安中证证券 B 份额：指华安中证全指证券公司份额按基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额

51、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

52、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

53、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

54、上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额的行为

55、自动分离：指投资者在场内认购的每 2 份华安中证证券份额在发售结束后按 1：1 比例自动转换为 1 份华安中证证券 A 份额和 1 份华安中证证券 B 份额的行为

56、配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的华安中证证券份额与华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆与合并

57、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份华安中证证券份额的场内份额申请转换成 1 份华安中证证券 A 份额与 1 份华安中证证券 B 份额的行为

58、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份华安中证证券 A 份额与 1 份华安中证证券 B 份额进行配对申请转换成 2 份华安中证证券份额的场内份额的行为

59、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基金份额的行为

60、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

61、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

62、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

63、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、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

64、巨额赎回：指本基金单个开放日，华安中证证券份额净赎回申请（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）超过上一开放日全部基金份额（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额）的 10%

65、元：指人民币元

66、基金收益：基金合同项下的基金收益即为基金利润，指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额

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

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、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

70、基金份额参考净值：指在基金份额净值计算的基础上，根据基金合同给定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为华安中证证券 A 份额参考净值、华安中证证券 B 份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

71、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

72、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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

73、基金产品资料概要：指《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自《信息披露办法》

实施之日起一年后开始执行

74、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

75、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998年6月4日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
- 6、注册资本：1.5亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司
- 8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
- 9、存续期间：持续经营
- 10、联系电话：（021）38969999
- 11、客户服务电话：40088-50099
- 12、联系人：王艳
- 13、网址：www.huaan.com.cn

#### （二）注册资本和股权结构

- 1、注册资本：1.5亿元人民币
- 2、股权结构

| 持股单位           | 持股占总股本比例 |
|----------------|----------|
| 国泰君安证券股份有限公司   | 20%      |
| 上海上国投资产管理有限公司  | 20%      |
| 上海锦江国际投资管理有限公司 | 20%      |
| 上海工业投资（集团）有限公司 | 20%      |
| 国泰君安投资管理股份有限公司 | 20%      |

#### （三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

##### （1）董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited 董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、权益投资部总经理、战略投资部总经理等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生，本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理；国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理（主持工作）、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理

组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

**独立董事：**

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

**(2) 监事会**

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

**(3) 高级管理人员**

朱学华先生，本科学历，20 年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，17 年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士，硕士研究生学历，18 年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生，硕士研究生学历，24 年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾 JP 摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，15 年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，19 年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

## 2、本基金基金经理

许之彦先生，理学博士，15 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任本基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基

金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

历任基金经理：

钱晶先生，自 2015 年 6 月 9 日至 2017 年 10 月 27 日担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金的基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童威先生，总经理

翁启森先生，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，总经理助理、指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

崔莹先生，基金投资部助理总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至 2019 年 6 月 30 日，公司目前共有员工 358 人（不含香港公司），其中 57.5%具有硕士及以上学历，92.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

#### （四）基金管理人的职责

根据《基金法》的规定，基金管理人应履行以下职责：

1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；

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、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定华安中证证券份额的基金份额净值和申购赎回价格、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额净值；

- 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、中国证监会规定的其他职责。

#### （五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及相关法律法规的行为的发生；

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，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）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，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；
- （8）其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

#### 5、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、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- （3）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，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。

#### （六）基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

###### （1）健全性原则

内部控制包括公司各项业务、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

公司各机构、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

公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

###### （5）成本效益原则

公司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。

##### 2、内部控制的组织体系

公司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。

（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。对公司的日常经营管理活动进行合规性监督和检查，直接向公司董事会和中国证监会报告。

（4）合规与风险管理委员会：合规与风险管理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非常设机构，以召开例会形式开展工作，向公司总经理负责。主要职责是定期和不定期审议公司合规报告、风险管理报告以及其他风险控制重大事项。

（5）合规监察稽核部：合规监察稽核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，对督察长负责。

(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。各部门的主管在权限范围内，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。

### 3、内部控制制度概述

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司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，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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、岗位职责、操作守则等的具体说明。

### 4、基金管理人内部控制五要素

内部控制的基本要素包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### (1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括公司治理结构体系和内部控制体系。公司内部控制体系又包括公司的经营理念和内控文化、内部控制的组织体系、内部控制的制度体系、员工的道德操守和素质等内容。

公司自成立以来，通过不断加强公司管理层和员工对内部控制的认识和控制意识，致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。逐步完善了公司治理结构、加强了公司内部合规控制建设，建立了公司内部控制体系。

#### (2) 风险评估

公司通过对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析、测试检查，发现风险，将风险进行分类、按重要性排序，找出风险分布点，分析其发生的可能性及对目标的影响程度，评估目前的控制程度和风险高低，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。在风险评估后，确定应进一步采取的对措施，对内部控制制度、规则、公司政策等进行修订和完善，并监督各个环节的改进实施。

#### (3) 控制活动

公司的一系列规章制度、业务规则在制定、修订的过程中，也得到了一贯的实施。主要

包括：组织结构控制、操作控制、会计控制。

#### ① 组织结构控制

公司各个部门的设置体现了部门之间的职责分工，及部门间相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成权责分明、严格有效的三道监控防线：

以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少差错或舞弊发生的风险。

各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理表单传递及信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督和检查的责任。

以合规监察稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

#### ② 操作控制

公司制定了一系列的基本管理制度，如风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、公司财务制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等，控制日常运作和经营中的风险。公司各业务部门在实际操作中遵照实施。

#### ③ 会计控制

公司确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上严格分开。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金资产的完整独立。

基本的会计控制措施主要包括：复核、对账制度；凭证、资料管理制度；会计账务的组织 and 处理制度。运用会计核算与账务系统，准确计算基金资产净值，采取科学、明确的资产估值方法和估值程序，公允地反映基金在估值时点的价值。

#### (4) 信息沟通

为了及时实现信息的沟通，有效地达成自下而上的报告和自上而下的反馈，公司采取以下措施：

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

制定了管理和业务报告制度，包括定期报告和不定期报告制度。按既定的报告路线和报告频率，在适当的时间向适当的内部人员和外部机构进行报告。

#### （5）内部监控

监控是监督和评估内部控制体系设计合理性和运行有效性的过程，对控制环境、控制活动等进行持续的检验和完善。

监察稽核人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度的有效实施。

公司合规监察稽核部对各业务部门内部控制制度的实施情况进行持续的检查。检验其是否符合设计要求，并及时地充实和完善，反映政策法规、市场环境、组织调整等因素的变化趋势，确保内控制度的有效性。

#### 5、基金管理人内部控制制度声明

基金管理人声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺公司将根据市场变化和业务发展来不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托

管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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。

##### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

##### 3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务人员具备从业资格；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。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 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。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，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。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）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行

解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金销售机构

#### 1、场外发售机构

##### （1）直销机构

##### 1）华安基金管理有限公司上海业务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31层

电话：（021）38969973

传真：（021）58406138

联系人：姚佳岑

##### 2）华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话：（010）57635999

传真：（010）66214061

联系人：刘雯

##### 3）华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路8号高德置地夏广场D座504单元

电话：（020）38082891

传真：（020）38082079

联系人：林承壮

##### 4）华安基金管理有限公司西安分公司

地址：陕西省西安市高新区唐延路35号旺座现代城H座2503

电话：（029）87651812

传真：（029）87651820

联系人：赵安平

##### 5）华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L

电话：（028）85268583

传真：（028）85268827

联系人：张晓帆

##### 6）华安基金管理有限公司沈阳业务部

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：(024) 22522733

传真：(024) 22521633

联系人：杨贺

7) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

(2) 代销机构

1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

2) 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客户服务电话：96518

网址：www.hazq.com

3) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918

网址：www.shzq.com

4) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼

法定代表人：其实

电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

5) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：4008886661

网址：www.myfp.cn

6) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899。

网址：www.e-rich.com.cn

7) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

8) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

客服电话：4008219031

网址：https://www.lufunds.com

9) 北京虹点基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

10) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人：彭运年

客户服务电话：4008909998

网址：www.jnlc.com

11) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

法定代表人：燕斌

客户服务电话：400-046-6788

网址：www.66zichan.com

12) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：李兴春

客户服务电话：4000676266

网址：www.leadbank.com.cn

13) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道1号保利国际广场南塔12楼

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网站：www.yingmi.cn

14) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20层

法定代表人：刘世安

电话：4008866338

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

15) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人：何沛良

客户服务电话：0769-961122

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

16) 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务电话：400-684-0500

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

17) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司

地址：江苏省常熟市新世纪大道58号

法定代表人：宋建明

客户服务电话：4009962000、0512-962000 或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询。

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

18) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：4000618518

网站：<https://danjuanapp.com/>

19) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

公司网站：<https://www.wg.com.cn/>

20) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

法定代表人：梁蓉

客户服务电话：400-6262-818

公司网址：www.5irich.com

21) 华金证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

客户服务电话：4008211357

办公地址：www.huajinsc.cn

22) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.fundzone.cn

23) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：易峥

客户服务电话：4008-773-772 0571-88920897

网址：www.5ifund.com

24) 宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

25) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

26) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：戴新装

客服电话：4008201515

网址：www.zhengtongfunds.com

27) 乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

客服电话：4000888080

网站：www.qiandaojr.com

28) 东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

电话：95531/400-8888588

网址：www.qh168.com.cn

29) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

30) 济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）

公司网站：www.jianfortune.com

31) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园 3 号

法定代表人：林卓

电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

32) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人：江卉

电 话：4000988511/ 4000888816

客服电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816

公司网址：http://fund.jd.com/

33) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：李一梅

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

34) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

客户服务电话：4000279899

网址：<http://www.buyfunds.cn>

35) 中民财富基金销售(上海)有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

法定代表人：弭洪军

全国统一客服电话：400-876-5716

公司网站：[www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

36) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

法定代表人：马勇

客服电话：4001161188

公司网站：<https://8.jrj.com/>

37) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：常州市和平中路413号

法定代表人：陆向阳

联系电话：(0519) 96005

网址：<http://www.jnbank.com.cn/index.html>

38) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809

法定代表人：戎兵

网址：<http://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

39) 上海通华财富基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

法定代表人：马刚

客户服务电话：021-61766900

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

40) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

电话：4006-788-887

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

41) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

42) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

客户服务电话：4008-588-588

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

43) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

44) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室

电话：400-100-3391

法定代表人：程刚

网址：<http://www.dianyingfund.com/>

45) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006-600109

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

46) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

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

47) 上海有鱼基金销售有限公司

法定代表人：林琼

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

客服电话：400-098-4800

网址：<http://www.youyufund.com/>

48) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

联系电话：021-65370077

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

客户服务电话：400-820-5369

49) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

客服热线：400-918-0808

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

50) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

(51) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层

5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客户服务电话：4000218850

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

(52) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼

法定代表人：胡燕亮

客户服务电话：021-50810673

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

(53) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系电话：010-56075718

传真号码：010-67767615

(54) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人：李招弟

电话：400-876-9988

网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(55) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

网址：www.yilucaifu.com

(56) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谱

联系电话：021-50701053

## 2、场内发售机构

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

### （三）律师事务所和经办律师

名称：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：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（021）2228 8888

传真：（021）2228 0000

联系人：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、沈熙苑

## 六、基金份额的分级与净值计算规则

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金的基础份额（简称“华安中证证券份额”）、华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“华安中证证券 A 份额”）和华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“华安中证证券 B 份额”）。其中，华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

### （二）基金份额的自动分离与分拆规则

1、基金发售结束后，投资人通过场内认购的全部华安中证证券份额将按照 1：1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的华安中证证券 A 份额和积极收益类的华安中证证券 B 份额，两类基金份额的基金资产与基础份额对应的基金资产合并运作。

2、基金合同生效后，华安中证证券份额设置单独的基金代码，接受场内与场外的申购和赎回；华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不接受申购或赎回。

3、基金开放申购赎回后，基金管理人将根据基金合同的约定办理华安中证证券份额与华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额之间的份额配对转换业务。投资人可在场内申购或赎回华安中证证券份额，并可选择将其场内申购的每两份华安中证证券份额按 1：1 的比例分拆为华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额各一份。投资者也可按 1:1 的比例将其持有的华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额申请合并为场内华安中证证券份额。

4、基金开放申购赎回后，投资者可在场外申购或赎回华安中证证券份额。投资者在场外申购的华安中证证券份额不进行分拆，该份额通过跨系统转托管至场内后，投资人可选择将其持有的每两份华安中证证券份额按 1：1 的比例分拆为华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额各一份。

5、无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见基金合同“基金的份额折算”），其所产生的华安中证证券份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的每两份场内华安中证证券份额按 1：1 的比例分拆为华安中证证券 A 份额和华安

中证证券 B 份额各一份。

未来在条件成熟后,基金管理人在履行相关程序并修改基金合同相关内容后,可对由定期份额折算及/或不定份额折算所产生华安中证证券份额进行自动分离。该变更无需召开基金份额持有人大会审议,但基金管理人应当在实施前依照《信息披露办法》的规定提前公告。

### (三) 华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值计算规则

根据华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的预期风险和预期收益特性不同,华安中证证券份额所自动分离或分拆的两类基金份额华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额具有不同的净值计算规则。

在本基金的存续期内,基金管理人将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额分别进行基金份额参考净值计算。华安中证证券 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额,本基金净资产优先确保华安中证证券 A 份额的本金及华安中证证券 A 份额累计约定基准收益;华安中证证券 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额,本基金在优先确保华安中证证券 A 份额的本金及累计约定基准收益后,将剩余净资产分配予华安中证证券 B 份额的净资产。

在本基金存续期内,华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的净值计算规则如下:

- 1、华安中证证券 A 份额的约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+4%”。

其中,本基金将以基金合同生效日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率(税后)为准,设定该日起(含该日)至第一个定期份额折算基准日(含该日)期间华安中证证券 A 份额适用的约定年基准收益率。

此后,本基金将以每年 12 月 15 日(遇节假日顺延)中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率(税后)为准,重新设定该日次日(含该日的次日)至次年 12 月 15 日(含该日,遇节假日顺延)期间华安中证证券 A 份额适用的约定年基准收益率。

- 2、本基金每个工作日对华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额进行基金份额参考净值计算。在进行华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额各自的基金份额参考净值计算时,本基金净资产优先确保华安中证证券 A 份额的本金及华安中证证券 A 份额累计约定基准收益,之后的剩余净资产计为华安中证证券 B 份额的净资产。华安中证证券 A 份额累计约定基准收益按依据华安中证证券 A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日华

安中证证券 A 份额应计收益的实际天数确定。

3、华安中证证券 A 份额的约定年基准收益率除以 365 天得到华安中证证券 A 份额的约定日基准收益率。华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值以 1.0000 元为基础,采用华安中证证券 A 份额的约定日基准收益率乘以应计约定收益的实际天数进行单利计算。华安中证证券 A 份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个基金份额折算(因华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元触发的不定期份额折算除外)基准日次日至净值计算日的实际天数。

4、本基金一份华安中证证券 A 份额的参考净值与一份华安中证证券 B 份额的参考净值之和等于两份华安中证证券份额的单位净值;

5、基金管理人并不承诺或保证华安中证证券 A 份额持有人的约定基准收益,如在本基金资产出现极端损失情况下,华安中证证券 A 份额持有人可能会面临无法取得约定基准收益甚至损失本金的风险。

#### (四) 本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金,按照华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值:

##### 1、华安中证证券份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$T$  日华安中证证券份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金,  $T$  日本基金基金份额的总数为华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额的份额数之和。

##### 2、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值计算

设  $T$  日为基金份额参考净值计算日;  $t = \min\{\text{自基金合同生效日至 } T \text{ 日的天数, 自最近一次基金份额折算 (因华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元触发的不定期份额折算除外) 基准日次日至 } T \text{ 日的天数}\}$ ;  $NAV$  为  $T$  日每份华安中证证券份额的基金份额净值;  $NAV_A$  为  $T$  日华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值;  $NAV_B$  为  $T$  日华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值;  $R$  为华安中证证券 A 份额的约定年基准收益率, 则:

$$NAV_A = 1 + R \times \frac{t}{365}$$

$$NAV_B = 2 \times NAV - NAV_A$$

华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （五）华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过，华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自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）通过方为有效。

## 七、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，经中国证监会 2015 年 5 月 14 日证监许可【2015】911 号文注册募集。

本基金自 2015 年 5 月 28 日起向全社会公开募集，截至 2015 年 6 月 3 日止募集工作顺利结束。

本基金为股票型证券投资基金。运作方式为契约型开放式，存续期限不定期。

本基金发售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、机构投资者和合格境外机构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。

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 249,366,591.33 元人民币，折合基金份额 249,366,591.33 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 18,376.62 元人民币，折合基金份额 18,376.62 份。本次募集所有资金已于 2015 年 6 月 8 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。本次募集有效认购户数为 5,645 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 249,384,967.95 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。按照有关法律规定，本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

## 八、基金合同的生效

根据《基金法》、《运作办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年6月9日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额上市交易。

华安中证证券份额在条件成熟后也可由基金管理人在履行相关程序后申请上市交易。若华安中证证券份额上市交易，基金管理人应当在实施前依照《信息披露办法》的规定提前公告。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （三）上市交易的时间

基金合同生效后六个月内，华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额《上市交易公告书》。

### （四）上市交易的规则

- 1、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易；
- 2、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日两类基金份额的基金份额参考净值；
- 3、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 4、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

（五）上市交易的费用

华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（六）上市交易的行情揭示

华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额（参考）净值。

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

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

（九）若深圳证券交易所、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，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 十、基金份额的申购与赎回

本基金的华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额不接受投资者的申购或赎回,只上市交易。本基金基金合同生效后,投资者可通过场内或场外两种方式进行华安中证证券份额的申购与赎回。

### (一) 申购和赎回场所

投资者办理华安中证证券份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理华安中证证券份额的场内申购和赎回业务。

投资者办理华安中证证券份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理华安中证证券份额的场外申购和赎回业务。

本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

### (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华安中证证券份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、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,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 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》的有关规定在指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华安中证证券份额的申购、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、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的,其华安中证证券份额申购、赎回价格为下一开放日华安中证证券份额申购、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华安中证证券份额基金份额净值为准进行计算;

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、场外赎回遵循“先进先出”原则,即基金份额持有人在场外销售机构赎回华安中证证券份额时按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4、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;

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

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》的有关规定在指定媒介上公告。

### （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,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;注册登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;注册登记机构确认赎回时,赎回生效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇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或其它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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。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。

### 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，本基金注册登记机构在 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，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

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，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

销售机构对申购和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请。申购和赎回的确认以注册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，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

### （五）申购和赎回的数额限制

1、投资人通过场外办理华安中证证券份额的申购时，首次单笔申购最低金额为 1 元（含申购费，下同），追加申购的单笔申购最低金额为 1 元。各代销机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资人通过场内办理华安中证证券份额的申购时，单笔申购最低金额为 50,000 元。

3、基金份额持有人在销售机构赎回中证证券份额的单笔赎回申请不得低于 1 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 1 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

4、本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 1 份。

5、本基金不对单个投资人累计持有的华安中证证券份额上限进行限制。

6、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华安中证证券份额的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。

7、基金管理人可以根据市场情况，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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （六）申购费用和赎回费用

##### 1、申购费率

##### （1）场外申购费率

本基金场外申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔 500 元。

除上述养老金客户外，其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下所示：

| 申购金额（M）     | 申购费率    |
|-------------|---------|
| M<100万      | 1.20%   |
| 100万≤M<200万 | 0.80%   |
| 200万≤M<500万 | 0.50%   |
| M≥500万      | 每笔1000元 |

##### （2）场内申购费率

本基金场内申购采用金额申购方法，场内申购不收取申购费。

##### （3）本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场

推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费率

### (1) 场外赎回费率

本基金的场外赎回费率按持有期递减，具体费率如下：

| 持有期限（Y）                  | 赎回费率  |
|--------------------------|-------|
| $Y < 7$ 天                | 1.50% |
| $7\text{天} \leq Y < 1$ 年 | 0.50% |
| $1\text{年} \leq Y < 2$ 年 | 0.25% |
| $Y \geq 2$ 年             | 0     |

注：一年指 365 天，两年为 730 天

### (2) 场内赎回费率

本基金的场内赎回费率固定为 0.50%，但对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的 1.5% 的赎回费。

(3) 本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其中，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在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》的有关规定在指定媒介上公告。

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申购费率和赎回费率。

## (七) 申购份额与赎回金额的计算

### 1、华安中证证券份额申购份额的计算

本基金场外申购和场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

申购费用 = 申购金额 × 申购费率 / (1 + 申购费率)

(对于适用固定金额申购费的申购，申购费用 = 固定申购费金额)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

场外申购份额计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后 2 位以后的部分四舍五入, 由此产生的误差计入基金财产。场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位, 再采用截位方式保留到整数位, 小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例 3: 某投资人投资 10 万元通过场外申购华安中证证券份额, 对应费率为 1.20%, 假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用=100,000×1.2%/ (1+1.2%) =1,185.77 元

净申购金额=100,000-1,185.77=98,814.23 元

申购份额=98,814.23/1.0150=97,353.92 份

即投资人投资 10 万元通过场外申购华安中证证券份额, 假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元, 则可得到 97,353.92 份华安中证证券份额。

例 4: 某投资人投资 10 万元通过场内申购华安中证证券份额, 对应费率为 0.00%, 假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用=0 元

净申购金额=100,000 元

申购份额=100,000/1.0150=98,522.17 份 (四舍五入保留至小数点后 2 位) =98,522 份 (保留至整数位)

实际净申购金额=98,522×1.0150=99,999.83 元

退款金额=0.17 元

即投资人投资 10 万元通过场内申购华安中证证券份额, 假设申购当日基金份额净值为 1.0150 元, 则可得到 98,522 份华安中证证券份额。

## 2、华安中证证券份额赎回金额的计算

本基金场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式, 赎回金额以当日基金份额净值为准计算, 计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后 2 位。赎回金额的计算公式为:

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例 5: 某投资人持有 10 万份华安中证证券份额, 持有一年六个月后在场外赎回, 赎回费率为 0.25%, 假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元, 则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=100,000×1.0150=101,500.00 元

赎回费用=101,500.00×0.25%=253.75 元

赎回金额=101,500.00—253.75=101,246.25 元

即投资人持有 10 万份华安中证证券份额，持有一年六个月后在场外赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元，则其可得到的赎回金额为 101,246.25 元。

例 6：某投资人持有 10 万份华安中证证券份额，持有一年六个月后在场内赎回，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.0150=101,500.00 元

赎回费用=101,500.00×0.50%=507.50 元

赎回金额=101,500.00—507.50=100,992.50 元

即投资人持有 10 万份华安中证证券份额，持有一年六个月后在场内赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.0150 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

### 3、基金份额净值的计算

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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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，由此产生的误差计入基金财产。

### （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运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 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时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障等发生异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、占本基金标的指数权重较大成分股出现暂停交易或股价异常的情形；
- 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

暂停接受华安中证证券份额的申购申请；

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

10、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、6、7、8、10 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指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。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障等发生异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

6、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时，可暂停接受投资人的赎回申请；

7、占本基金标的指数权重较大成分股出现暂停交易或股价异常的情形；

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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受华安中证证券份额的赎回申请；

9、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赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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。当出现暂停赎回或延缓支付

赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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）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华安中证证券份额净赎回申请（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）超过前一开放日的基金总份额（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 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或部分延期赎回。

（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（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 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。

若基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额）的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。

（3）暂停赎回：华安中证证券份额连续 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，可暂停接受华安中证证券份额的赎回申请；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，并应当在指定媒介上进行公告。

#### （4）巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，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，在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### （十一）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指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个估值日的华安中证证券份额的基金份额净值。

3、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指定媒介上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。

#### （十二）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华安中证证券份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，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。

#### （十三）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理华安中证证券份额的定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款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。

## 十一、基金份额的登记、转托管及其他业务

### （一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转托管从场内转入的华安中证证券份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额以及场内认购、申购或通过跨系统转托管从场外转入的华安中证证券份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的深圳证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的华安中证证券份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的华安中证证券份额可以申请场外赎回。

3、登记在证券登记结算系统中的华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 1:1 比例申请合并为场内华安中证证券份额后再申请场内赎回。

### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理华安中证证券份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有华安中证证券份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额上市交易或华安中证证券份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、募集期内不得办理系统内转托管。

5、基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

6、系统内转托管的具体办理方法参照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司以及基金代销机构的有关规定。

### （三）跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的华安中证证券份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、华安中证证券份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

3、本基金处于募集期内、权益分派期间或华安中证证券份额处于质押、冻结状态时，不得办理跨系统转托管。

4、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

#### （四）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。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注册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注册登记机构的规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

#### （五）基金的冻结和解冻

注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。

#### （六）基金份额的质押

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定和实施相应的业务规则。

## 十二、基金份额的配对转换

本基金基金合同生效后,在华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额的存续期内,基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

(一) 份额配对转换是指华安中证证券场内份额与华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额之间的配对转换,包括以下两种方式的配对转换:

### 1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份华安中证证券场内份额申请转换成 1 份华安中证证券 A 份额与 1 份华安中证证券 B 份额的行为。

### 2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华安中证证券 A 份额与 1 份华安中证证券 B 份额申请转换成 2 份华安中证证券场内份额的行为。

### (二) 份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构,并予以公示。

### (三) 份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日(基金管理人公告暂停份额配对转换时除外),具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

### (四) 份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请分拆为华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的华安中证证券场内份额必须是偶数。

3、申请合并为华安中证证券场内份额的华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4、华安中证证券场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为华安中证证券场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### （六）暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益时决定暂停份额配对转换的情形。

2、深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形之一且基金管理人决定暂停配对转换的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

#### （七）份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可收取一定的佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。

（八）深圳证券交易所、基金注册登记机构调整上述规则，基金合同将相应予以修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证全指证券公司指数的成分股及其备选成分股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### （三）标的指数

本基金的标的指数为中证全指证券公司指数。

如果中证全指证券公司指数被停止编制及发布，或中证全指证券公司指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证全指证券公司指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的

标的指数和投资对象；并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

#### (四) 投资策略

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

#### (五) 投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证全指证券公司指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金非指数化投资部分持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

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

证金、应收申购款等；

(4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(7) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；

(15) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 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

合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(17) 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；

(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。

除上述第(3)、(12)、(16)、(17)项外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，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。

## 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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 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。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### （六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为  $95\% \times \text{中证全指证券公司指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

由于本基金投资标的指数为中证全指证券公司指数，且每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金将业绩比较基准定为  $95\% \times \text{中证全指证券公司指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

如本基金标的指数变化，则业绩比较基准中的标的指数将相应调整。业绩比较基准的调整根据标的指数的变更程序执行。

#### （七）风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

从本基金所分离的两类基金份额来看，华安中证证券 A 份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；华安中证证券 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

#### （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、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （九）基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## （十）基金投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日。

### 1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 242,427,747.59 | 91.86        |
|    | 其中：股票             | 242,427,747.59 | 91.86        |
| 2  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 17,782,763.65  | 6.74         |
| 7  | 其他各项资产            | 3,713,243.16   | 1.41         |
| 8  | 合计                | 263,923,754.40 | 100.00       |

### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | —              | —            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | —              | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —              | —            |
| J  | 金融业              | 242,427,747.59 | 94.30        |
| K  | 房地产业             | —              | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —              | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | —              | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —              | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —              | —            |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 242,427,747.59 | 94.30        |

### 3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|    |        |      |           |               |       |
|----|--------|------|-----------|---------------|-------|
| 1  | 600030 | 中信证券 | 1,549,364 | 38,393,239.92 | 14.93 |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 1,727,245 | 24,233,247.35 | 9.43  |
| 3  | 601211 | 国泰君安 | 968,166   | 19,508,544.90 | 7.59  |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 701,274   | 15,715,550.34 | 6.11  |
| 5  | 600999 | 招商证券 | 613,795   | 10,753,688.40 | 4.18  |
| 6  | 000776 | 广发证券 | 635,087   | 10,269,356.79 | 3.99  |
| 7  | 600958 | 东方证券 | 769,206   | 9,168,935.52  | 3.57  |
| 8  | 000166 | 申万宏源 | 1,451,011 | 8,009,580.72  | 3.12  |
| 9  | 601377 | 兴业证券 | 1,003,773 | 7,277,354.25  | 2.83  |
| 10 | 002736 | 国信证券 | 527,331   | 7,140,061.74  | 2.78  |

### 3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 11 投资组合报告附注

11.1 2018年6月21日，国信证券股份有限公司因保荐业务及财务顾问业务涉嫌违反证券法律法规收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2018]46号），对于国信证券保荐业务行为，责令其改正，给予警告，没收保荐业务收入100万元，并处以300万元罚款；对于国信证券并购重组财务顾问业务行为，责令其改正，没收并购重组财务顾问业务收入600万元，并处以1,800万元罚款。本报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 31,437.30    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,899.43     |
| 5  | 应收申购款   | 3,677,906.43 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | —            |
| 9 | 合计 | 3,713,243.16 |

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

##### 11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十四、基金的业绩

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

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### （一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2018 年 12 月 31 日）

| 阶段                                                   | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|------------------------------------------------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同生效<br>（2015 年 6 月 9<br>日）起至 2015 年<br>12 月 31 日 | -18.47%      | 3.29%               | -37.55%            | 3.94%                 | 19.08% | -0.65% |
| 2016 年 1 月 1 日<br>至 2016 年 12 月<br>31 日              | -17.10%      | 2.12%               | -17.81%            | 2.13%                 | 0.71%  | -0.01% |
| 2017 年 1 月 1 日<br>至 2017 年 12 月<br>31 日              | -11.36%      | 1.01%               | -11.72%            | 1.02%                 | 0.36%  | -0.01% |
| 2018 年 1 月 1 日<br>至 2018 年 12 月<br>31 日              | -23.41%      | 1.80%               | -24.89%            | 1.81%                 | 1.48%  | -0.01% |

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 十五、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、银行存款本息、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注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产保管和处分

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、基金注册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。

## 十六、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、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），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、处于未上市期间的权益类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权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、交易所市场交易的固定收益品种（固定收益品种指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、证券公司短期债、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取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；

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。

4、银行间市场交易的固定收益品种，选取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。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，按成本估值。

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

6、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。

7、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的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

基金管理人应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，将各类基金份额的基金份额（参考）净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （五）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。当华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值小数点后 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、或注册登记机构、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，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，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）错误偏差达到华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的 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；错误偏差达到华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

（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。

### （六）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它情形。

### （七）基金净值的确认

基金资产净值和华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考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

人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考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，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （八）特殊情况的处理

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

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，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。

## 十七、基金的收益与分配

在存续期内，本基金（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额）不进行收益分配。

如果法律法规或监管部门取消有关限制，则基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，在履行适当程序后，可以对上述收益分配原则进行修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 十八、基金的费用与税收

### (一)基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 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、基金的上市费用；
- 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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (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 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如

下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如上述指数许可使用协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

4、除管理费、托管费、指数使用费之外的基金费用，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、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) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒介上刊登公告。

#### (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。

## 十九、基金份额折算

### （一）定期份额折算

在华安中证证券 A 份额和华安中证证券份额存续期内的每个会计年度的基金份额定期折算基准日（基金合同生效不足六个月的除外），本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、定期份额折算的基准日

每个会计年度的 12 月 15 日（遇节假日顺延）。

#### 2、定期份额折算的对象

基金份额定期折算基准日登记在册的华安中证证券 A 份额和华安中证证券份额，华安中证证券 B 份额不参与定期折算，除非定期折算时同时满足不定期折算的条件。

#### 3、定期份额折算的频率

每年折算一次。

#### 4、定期份额折算的方式

华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额按照规定的净值计算规则进行基金份额参考净值计算，对华安中证证券 A 份额的约定基准收益进行定期份额折算，每 2 份华安中证证券份额将按 1 份华安中证证券 A 份额获得约定基准收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后，华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例不变。

基金份额折算基准日折算前，华安中证证券 A 份额的基金份额参考参考净值超出 1.0000 元部分，将被折算为场内华安中证证券份额分配给华安中证证券 A 份额持有人。华安中证证券份额持有人持有的每 2 份华安中证证券份额将获得按照 1 份华安中证证券 A 份额分配的新增华安中证证券份额。

持有场外华安中证证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华安中证证券份额；持有场内华安中证证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华安中证证券份额。经过上述份额折算，华安中证证券 A 份额的参考净值和华安中证证券份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度的 12 月 15 日（遇节假日顺延）为定期份额折算基准日，本基金将对华安中证证券 A 份额和华安中证证券份额进行定期份额折算。有关计算公式如下：

(1) 华安中证证券 A 份额折算

定期份额折算前后，华安中证证券 A 份额数不变，即： $NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)$$

华安中证证券 A 份额持有人新增的场内华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：华安中证证券 A 份额定期份额折算基准日折算前的基金份额参考净值

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值

华安中证证券 A 份额折算成华安中证证券份额的场内份额取整计算(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。

(2) 华安中证证券 B 份额不参与定期份额折算，其基金份额参考净值与份额数在定期折算前后保持不变。

(3) 华安中证证券份额折算

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)$$

华安中证证券份额持有人新增的华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NUM^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.0000}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后华安中证证券份额的份额数 = 定期份额折算前华安中证证券份额的份额数 + 华安中证证券份额持有人新增的华安中证证券份额的份额数

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NAV_A^{\text{前}}$ ：华安中证证券 A 份额定期份额折算基准日折算前的基金份额参考净值

$NUM^{\text{前}}$ ：定期份额折算前华安中证证券份额的份额数

华安中证证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安中证证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施定期份额折算时，折算日折算前华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的上市交易和华安中证证券份额的申购、赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告。

#### 7、特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，将优先按照不定期份额折算的规则依次进行份额折算。

此外，为防止极端情况下基金份额折算频率过高，若本基金在定期份额折算基准日前 20 个工作日内（含第前 20 个工作日）发生过基金合同约定的因华安中证证券 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元而触发的不定期份额折算，则基金管理人有权根据实际情况决定是否进行定期份额折算并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （二）不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时；当华安中证证券 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元时。

1、当华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时

当华安中证证券份额的基金份额净值达到 1.5000 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

（1）不定期份额折算基准日

华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金管理人即可确定折算基准日。

（2）不定期份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额。

（3）不定期份额折算频率

不定期。

（4）不定期份额折算方式

当华安中证证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额进行不定期份额折算。

华安中证证券 B 份额、华安中证证券份额三类份额按照如下公式进行份额折算：

① 华安中证证券 A 份额

此类不定期折算不改变华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值及其基金份额数。

② 华安中证证券 B 份额

份额折算原则：

A. 份额折算后华安中证证券 B 份额与华安中证证券 A 份额的份额配比数保持 1:1 的配比；

B. 华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值超过华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的华安中证证券份额；

C. 份额折算后，华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值三者相等；

D. 份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额持有人在份额折算后将持有华安中证证

券 B 份额与新增的场内华安中证证券份额。

$$NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$$

$$NAV_B^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

华安中证证券 B 份额持有人新增的场内华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - NAV_A^{\text{前}})}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值

$NAV_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NAV_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NAV^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值

经折算后华安中证证券 B 份额的基金份额持有人新增的场内华安中证证券份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### ③ 华安中证证券份额

份额折算原则：

场外华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场外华安中证证券份额，场内华安中证证券份额持有人份额折算后获得新增场内华安中证证券份额。

$$NAV^{\text{后}} = NAV_A^{\text{前}}$$

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额数

$NUM^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额数

华安中证证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安中证证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施不定期份额折算时，折算日折算前华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的上市交易和华安中证证券份额的申购、赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果。

### 2、当华安中证证券 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元时

当华安中证证券 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### （1）不定期份额折算基准日

华安中证证券 B 份额的参考净值达到 0.2500 元，基金管理人即可确定折算基准日。

#### （2）不定期份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额。

#### （3）不定期份额折算频率

不定期。

#### （4）基金份额折算方式

当华安中证证券 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元后，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的比例为 1：1，份额折算后华安中证证券份额的基金份额净值以及华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的参考净值均调整为 1.0000 元。

华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额、华安中证证券份额三类份额按照如下公式进行份额折算。

① 华安中证证券 B 份额

份额折算原则：

份额折算前华安中证证券 B 份额的资产净值与份额折算后华安中证证券 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 B 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

② 华安中证证券 A 份额

份额折算原则：

- A. 份额折算前后华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额始终保持 1：1 配比；
- B. 份额折算前华安中证证券 A 份额的资产与份额折算后华安中证证券 A 份额的资产净值及其新增场内华安中证证券份额的资产净值之和相等；
- C. 份额折算前华安中证证券 A 份额的持有人在份额折算后将持有华安中证证券 A 份额与新增场内华安中证证券份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

华安中证证券 A 份额持有新增的场内华安中证证券份额的份额数=

$$\frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.0000}{1.0000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NUM_A^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 A 份额的基金份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券 B 份额的基金份额数

③ 华安中证证券份额：

份额折算原则：

份额折算前华安中证证券份额的资产净值与份额折算后华安中证证券份额的资产净值相等。

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{1.0000}$$

其中：

$NAV^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额净值

$NUM^{\text{前}}$ ：不定期份额折算前华安中证证券份额的基金份额数

$NUM^{\text{后}}$ ：不定期份额折算后华安中证证券份额的基金份额数

华安中证证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；华安中证证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

在实施不定期份额折算时，折算日折算前华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额参考净值、华安中证证券 B 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的上市交易和华安中证证券份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告折算结果。

## 二十、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对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。更换会计师事务所所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 二十一、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 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。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：

- 1、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

（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指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

(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,并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《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指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、《上市交易公告书》

基金管理人应当在基金管理人应当在本基金的基金份额上市交易 3 个工作日前,将《上市交易公告书》登载在指定媒介上。

## 5、基金份额(参考)净值公告、基金份额累计净值公告

《基金合同》生效后,在华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额开始上市交易或开始办理华安中证证券份额申购赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次华安中证证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计参

考净值。

在华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额开始上市交易或开始办理华安中证证券份额申购赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的华安中证证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的华安中证证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计参考净值。

#### 6、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华安中证证券份额申购、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者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、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，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 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季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类

别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### 8、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》的规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长；
- (9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- (11) 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (12) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (14) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

- (15) 基金收益分配事项;
- (16) 基金管理费、基金托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- (17) 基金份额净值计价错误达华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值百分之零点五;
- (18) 基金改聘会计师事务所;
- (19) 更换基金注册登记机构;
- (20) 华安中证证券份额开始办理申购、赎回;
- (21) 华安中证证券份额发生巨额赎回并延期办理;
- (22) 华安中证证券份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;
- (23) 华安中证证券份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;
- (24) 本基金开始办理或暂停接受配对转换申请;
- (25) 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务;
- (26) 本基金实施基金份额折算;
- (27) 华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额上市交易;
- (28) 华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额暂停上市、恢复上市或终止上市;
- (29) 基金推出新业务或服务;
- (30) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时;
- (31) 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和基金合同约定的其他事项。

#### 9、澄清公告

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

#### 10、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。

#### 11、投资股指期货相关公告

本基金将在季度报告、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。

## 12、清算报告

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

## 13、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（参考）净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息披露信息的报刊。

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指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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

### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信

息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，以供社会公众查阅、复制。

（八）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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致暂停估值的；
- 4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

（九）法律法规或中国证监会对信息披露另有规定的，从其规定。

## 二十二、风险揭示

### （一）投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于标的指数成份股和备选成份股股票资产与债券资产市场价格的波动。影响股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于上市公司的股票与债券，其收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票与债券，其收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。

##### （4）通货膨胀风险

基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

##### （5）汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致本基金所投资的上市公司业绩及其股票价格。

##### （6）上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

### （7）债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

### （8）再投资风险

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

## 2、信用风险

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

## 3、流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资人大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”章节。

### （2）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1）基金合同约定：“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具”，其中“投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%”，从投资范围和所处的行业上看，基金资产及该类股票的流动性良好；

2）从投资限制上看，基金合同约定：“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%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

1）暂停接受赎回申请；

2）延缓支付赎回款项；

3) 延期办理;

4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施, 详见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“(十) 巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

(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

基金管理人经与基金托管人协商, 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, 对赎回申请等进行适度调整, 作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施, 包括但不限于:

1) 暂停接受赎回申请

具体措施, 详见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

2) 延缓支付赎回款项或延期办理

上述具体措施, 详见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“(十) 巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费, 并将上述赎回费全额计入基金财产。

4) 暂停基金估值

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

5) 中国证监会认定的其他措施。

(二) 本基金特有的风险

1、指数化投资风险

(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）基金投资组合回报与目标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目标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，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

2）由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标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误差。

3）成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差。

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误差。

5）由于基金应对日常赎回保留的少量现金、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，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

6）其他因素产生的跟踪误差。如未来法律法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差；因基金申购与赎回带来的现金变动等。

### （4）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

## 2、基金运作的特有风险

本基金为分级基金，华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的运作不同于普通的开放式基金和封闭式基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：

### （1）上市交易风险

基金合同生效后，华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额将在深圳证券交易所上市交易，由于上市期间可能因收益分配、份额折算等原因导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额，产生风险；同时，可能因上市后流动性不足导致华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额产生流动性风险。

### （2）杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分

离的两类基金份额来看，华安中证证券 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安中证证券 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。由于华安中证证券 B 份额内含杠杆机制的设计，华安中证证券 B 份额参考净值的变动幅度将大于华安中证证券份额的基金份额净值和华安中证证券 A 份额参考净值的变动幅度，即华安中证证券 B 份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

### （3）基金份额的折/溢价交易风险

华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，其各自的交易价格与参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额分别交易，由于份额配对转换机制的存在，其中一类基金份额折/溢价的变化可能影响另一类份额的折/溢价。

### （4）基金份额风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在华安中证证券份额净值达到 1.5000 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原华安中证证券 B 份额持有人将会获得一定比例的华安中证证券份额，因此原华安中证证券 B 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在华安中证证券 B 份额参考净值达到 0.2500 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原华安中证证券 A 份额持有人将会获得一定比例的华安中证证券份额，因此，原华安中证证券 A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于华安中证证券 A 份额会在每个会计年度 12 月 15 日（但基金合同另有约定的除外），把约定收益折算为场内华安中证证券份额的设计，使原华安中证证券 A 份额持有人将会获得一定比例的华安中证证券份额，因此，原华安中证证券 A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

### （5）份额折算风险

1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。因此，

在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

2) 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买华安中证证券 A 份额或华安中证证券 B 份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金代销资格,而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资人赎回基金份额。因此,如果投资人通过不具备基金代销资格的证券公司购买华安中证证券 A 份额或华安中证证券 B 份额,在其参与份额折算后,则折算新增的华安中证证券份额并不能被赎回。此风险需要引起投资人注意,投资人可以选择在份额折算前将华安中证证券 A 份额或华安中证证券 B 份额卖出,或者将新增的华安中证证券份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

(6) 份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后,在华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的存续期内,基金管理人将根据基金合同的约定办理华安中证证券份额与华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额之间份额配对转换。一方面,份额配对转换业务的办理可能改变华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的市场供求关系,从而可能影响其交易价格;另一方面,份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形,投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

(7) 约定收益实现的风险

在存续期内,本基金(包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额)将不进行收益分配。

在每个基金会计年度 12 月 15 日(遇节假日顺延,基金合同另有约定的除外),基金管理人将根据基金合同的约定对本基金华安中证证券份额和华安中证证券 A 份额实施定期份额折算以分配约定收益。基金份额折算后,如果出现新增份额的情形,投资人可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式将约定收益兑现以获取投资回报,但是,投资人通过变现折算后的新增份额以获取约定收益的方式并不等同于基金收益分配,投资人不仅须承担相应的交易成本,还可能承担基金份额在卖出或赎回过程中的价格波动风险。

3、股指期货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人权益遭受较大损失。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。

### （三）管理风险

#### 1、管理风险

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,而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上,例如资产配置、类属配置不能符合基金合同的要求,不能达到预期收益目标;也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

#### 2、新产品创新带来的风险

随着中国证券市场与国际市场的接轨,各种国外的投资工具也逐步引入,这些新的投资工具在为基金资产保值增值的同时,也会产生一些新的投资风险,例如可转换债券带来的转股风险,利率期货带来的期货投资风险等。同时,基金管理人可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误,产生投资风险。

### （四）合规性风险

指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

### （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）投资科创板风险

投资科创板股票存在的风险包括但不限于:

#### 1. 退市风险

科创板退市制度较主板更为严格,退市时间更短,退市速度更快;退市情形更多,新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形;执行标

准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

## 2、市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、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，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌停限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

## 3、流动性风险

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块流动性可能弱于 A 股，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

## 4、集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

## 5、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

## 6、政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

## （七）其他风险

### 1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。

### 2、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、注册登记系统瘫痪、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。

### 3、大额赎回风险

本基金是一开放式基金，基金规模将随着投资人对基金份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售债券和股票以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### 5、其他不可抗力风险

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。

### 声明：

1、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。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过销售代理机构销售。但是，本基金并不是销售代理机构的存款或负债，也没有经销售代理机构担保或者背书，销售代理机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十三、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。对于法律法规规定或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须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现;
  - (4) 制作清算报告;
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
  - (7) 对基金剩余财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为六个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (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, 分别计算华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的应计分配比例, 并据此由华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的基金份额持有人根据其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。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 二十五、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 二十六、对基金投资人的服务

本公司承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，适时对服务项目进行调整。主要服务内容如下：

### （一）投资人对账单服务

本公司在每个自然年度结束后20个工作日内向定制纸质对账单的基金份额持有人寄送纸质对账单；每月向定制电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。

### （二）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供7X24小时的基金净值信息、投资人账户交易情况、基金产品与服务等信息的自助查询。

客户服务中心人工座席在交易日提供人工服务，基金投资人可以通过客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、账户资料修改等专项服务。

### （三）网络在线服务

投资人可以通过本公司网站的“在线客服”在线就基金投资、交易操作中的各种问题进行咨询互动或留言。

### （四）信息定制服务

投资人可以通过拨打本公司客服热线、发送邮件或者直接登录本公司网站定制电子对账单及资讯服务等各类信息服务。

### （五）投诉受理服务

投资人可以通过各销售机构网点柜台、客服热线人工服务、在线客服、客服电子邮箱、纸质信函等多种不同的渠道提出投诉或意见。本公司对于工作日期间受理的投诉，原则上在受理投诉后2个工作日内回复；对于非工作日提出的投诉，将在顺延的2个工作日内进行回复。

### （六）网站交易服务

依据相关的招募说明书、基金合同的约定以及《业务规则》的规定，本公司可向个人投资人和机构投资人提供基金电子直销交易服务。具体业务规则详见基金管理人网站说明。

### （七）基金管理人客户服务联系方式

客户服务中心热线：40088-50099（免长途话费）

客户服务传真：（021）33626962

公司网址：www.huaan.com.cn

电子信箱：service@huaan.com.cn

客服地址：上海市四平路1398号 同济联合广场B座 14楼

邮政编码：200092

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务中心热线，或通过电子邮件、传真、信件等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。

## 二十七、其他应披露事项

1. 近三年基金管理人及其高级管理人员没有受到过中国证监会及工商、财税等有关机关的处罚。

### 2. 本期公告事项

| 序号 | 公告事项                                              | 信息披露报纸名称                                | 披露日期       |
|----|---------------------------------------------------|-----------------------------------------|------------|
| 1  | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告                     | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.12 |
| 2  | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告                 | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.12 |
| 3  | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间华安中证证券A份额停复牌的公告 | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.18 |
| 4  | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之华安中证证券A份额约定年基准收益率调整的公告     | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.18 |
| 5  | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告            | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.19 |
| 6  | 关于华安中证证券A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告                     | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》          | 2018.12.19 |

|    |                                               |                                         |            |
|----|-----------------------------------------------|-----------------------------------------|------------|
|    |                                               | 和公司网站                                   |            |
| 7  | 华安基金关于参加君德汇富优惠活动的公告                           | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.21 |
| 8  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众升财富为销售机构的公告              | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.26 |
| 9  | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2018.12.28 |
| 10 | 关于旗下部分基金参加基煜基金费率优惠活动的公告                       | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.01.15 |
| 11 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金2018年第4季度报告               | 《证券时报》<br>和公司网站                         | 2019.01.21 |
| 12 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金更新的招募说明书（2019年第1号）        | 公司网站                                    | 2019.01.23 |
| 13 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要（2019年第1号）      | 《证券时报》<br>和公司网站                         | 2019.01.23 |
| 14 | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及定期定额投资的公告 | 《证券时报》<br>和公司网站                         | 2019.02.26 |
| 15 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金不定期折算公告                   | 《证券时报》<br>和公司网站                         | 2019.02.26 |
| 16 | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券                            | 《证券时报》                                  | 2019.02.27 |

|    |                                                                           |                                                    |            |
|----|---------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------|
|    | 投资基金办理不定期份额折算业务期间华安中证证券B份额停复牌的公告                                          | 和公司网站                                              |            |
| 17 | 关于华安中证全指证券公司指数分级不定期份额折算结果及恢复交易的公告                                         | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.2.28  |
| 18 | 关于华安中证全指证券公司指数分级不定期份额折算前收盘价调整的公告                                          | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.2.28  |
| 19 | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金调整场内大额申购、定投及转换转入业务和恢复场外大额申购、定投及转换转入业务并暂停跨系统转托管业务的公告 | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.03.09 |
| 20 | 关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金增加一路财富为销售机构的公告                                      | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.03.12 |
| 21 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告                                              | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.03.29 |
| 22 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告                                             | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.03.29 |
| 23 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金2018年年度报告（摘要）                                         | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.03.30 |
| 24 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金2018年年度报告                                             | 公司网站                                               | 2019.03.30 |
| 25 | 关于华安基金撤销沈阳分公司的公告                                                          | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、                     | 2019.04.10 |

|    |                                 |                                                    |            |
|----|---------------------------------|----------------------------------------------------|------------|
|    |                                 | 《中国证券报》<br>和公司网站                                   |            |
| 26 | 华安基金关于旗下基金参加植信基金优惠活动的公告         | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.04.12 |
| 27 | 华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金2019年第1季度报告 | 《证券时报》<br>和公司网站                                    | 2019.04.20 |
| 28 | 关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构的公告          | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.04.27 |
| 29 | 华安基金关于旗下基金参加民生银行优惠活动的公告         | 《上海证券报》、<br>《证券时报》、<br>《证券日报》、<br>《中国证券报》<br>和公司网站 | 2019.05.14 |

## 二十八、招募说明书存放及查阅方式

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、深圳证券交易所，供社会公众查阅、复制。投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

## 二十九、备查文件

### （一）备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

（二）存放地点：除第 6 项在基金托管人处外，其余文件均在基金管理人的住所。

（三）查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年三月七日

## 附件一：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、义务

#### 1、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的华安中证证券份额，依法转让其持有的华安中证证券 A 份额或华安中证证券 B 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、基金销售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、基金份额持有人的义务

- （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）缴纳基金认购、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定；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 3、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律法规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注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律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、赎回和转换申请；
- (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、融券；
- (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、转托管、配对转换、非交易过户、定期定额投资等方面的业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率和托管费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (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。

#### 4、基金管理人的义务

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 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，确定华安中证证券份额的基金份额净值和申购赎回价格、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值；

(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；

(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 15 年以上；

(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。

## 5、基金托管人的权利

(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。

## 6、基金托管人的义务

- (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；
- (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、华安中证证券份额的基金份额净值和申购赎回价格、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值；
- (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 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (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监管机构，并通知基金管理人；

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

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

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

### 1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止《基金合同》，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

6) 变更基金类别；

7) 本基金与其他基金的合并，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

8) 变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外；

9) 变更基金份额持有人大会程序，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外；

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) 单独或合计持有华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自份额 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) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整华安中证证券份额的申购费率、调低赎回费率；

4) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少或调整基金份额类别及定义，变更收费方式；

5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

6) 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变化；

7) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

8) 在不违反法律法规规定和《基金合同》约定、且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、注册登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金交易、配对转换、非交易过户、定期定额投资、收益分配等业务规则；

9) 未来条件成熟时在法律法规允许的范围内申请华安中证证券份额的上市交易，并可以根据届时有有效的上市交易规则修改《基金合同》的相关内容；

10) 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。

2、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) 单独或合计持有华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自份额 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，单独或合计持有华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自份额 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。

(5) 单独或合计持有华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自份额 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，单独或合计持有华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自份额 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。

### 3、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，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 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) 授权委托书证明的内容要求(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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人,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。

#### 4、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、通讯开会及法律法规、中国证监会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,有效的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额少于本基金在权益登记日华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自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

代表的有效的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自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的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明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）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额小于在权益登记日华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自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）华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

4）上述第 3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议

程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

## 5、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，则由出席大会的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自基金份额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。

## 6、表决

华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自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华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额各自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》、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书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## 7、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怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## （2）通讯开会

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

## 8、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，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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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。

9、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的部分，如将来法律法规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、程序以及基金财产清算方式

### 1、本基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （3）《基金合同》约定的其他情形；
- （4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 2、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具

有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 4、清算费用

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

#### 5、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，分别计算华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的应计分配比例，并据此由华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、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。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (四) 争议的处理和适用的法律

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

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》受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

## 附件二：托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层

邮政编码：200120

法定代表人：朱学华

成立日期：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；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；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证全指证券公司指数的成分股及其备选成分股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、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）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金非指数化投资部分持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（3）每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年

以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(5) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(7) 本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 8%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 本基金管理人管理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%；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；

(15) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

(17)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；

(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。

除上述第(3)、(12)、(16)、(17)项外，因证券市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管部门另有规定时，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。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

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他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

4、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。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，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。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，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

（1）本基金投资的受限证券与上文所述流动性受限资产并不相同，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

（2）基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何

责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- 4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 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，在中国证监会指定媒体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。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应按规定编制临时报告书，予以公告。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- 1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
- 2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- 3) 有关比例限制的执行情况。
- 4) 信息披露情况。

(6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6、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（参考）净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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）基金管理人有关基金托管人的业务核查

1、基金管理人有关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、证券账户以及投资所需的其他专用账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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。

3、基金管理人发现基金托管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

##### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。

（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，基金托管人对此不承担任何责任。

（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。

##### 2、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在基金托管人的营业机构开立的“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》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银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格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。

### 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 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。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4、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。

证券账户开户费由本基金财产承担，于证券账户开立次月第七个工作日由基金托管人从本基金银行存款账户中直接扣收；若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收，基金托管人顺延至次月第七个工作日进行扣收；证券账户开立后连续六个月内，因本基金银行存款余额持续不足导致证券账户开户费无法扣收的，基金管理人有权先行支付基金托管人垫付的开户费用。

(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。

### 5、债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，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。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

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

(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。

#### 7、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、银行存款开户证实书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。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。。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。

#### 8、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包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应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为《基金合同》终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供合同复印件，并在复印件上加盖公章，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

## 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金管理人按照《基金合同》中的约定计算华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值。

华安中证证券份额的基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的总数量计算。本基金作为分级基金，T 日基金份额的总数为华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额和华安中证证券份额的份额数之和。华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额和华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(2) 基金管理人应每交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将基金净值信息发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## 2、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、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### (2) 估值方法

#### 1) 证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），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) 处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

a、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；

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

c、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定

确定公允价值。

3) 交易所市场交易的固定收益品种（固定收益品种指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、证券公司短期债、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值

a、对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取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；

b、对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

c、对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。

4) 银行间市场交易的固定收益品种，选取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。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，按成本估值。

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

6) 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。

7) 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，基金资产净值和华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券A份额和华安中证证券B份额的基金份额参考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，基金管理人向基金托管人出

具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

### （3）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

### 3、基金份额净值错误的处理方式

（1）当华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的 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；错误偏差达到华安中证证券份额的基金份额净值、华安中证证券 A 份额的基金份额参考净值或华安中证证券 B 份额的基金份额参考净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔

付。

(3) 由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误, 基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差, 以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的, 从其规定。如果行业另有通行做法, 双方当事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。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

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

(2) 因不可抗力致使基金管理人、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。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、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。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的计算和公告的, 以基金管理人的账册为准。

#### 7、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

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

### 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。

8、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。

## （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注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。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报前，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）争议解决方式

基金管理人与基金托管人之间因托管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中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国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，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更程序

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。

##### 2、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。

##### 3、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

##### （4）基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算结果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。

##### （6）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用

由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

（7）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，分别计算华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的应计分配比例，并据此由华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额与华安中证证券 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

（8）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（9）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。