

华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指  
数证券投资基金更新的招募说明书  
(2025 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司  
基金托管人：兴业银行股份有限公司

二零二五年十一月

## 重要提示

一、本基金于2025年9月8日经中国证券监督管理委员会《关于准予华安中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2025】1991号）注册，进行募集。本基金的基金合同自2025年9月17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投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

二、本基金标的指数为中证AAA科技创新公司债指数，该指数编制方案如下：

### 1、样本空间

中证AAA科技创新公司债指数的样本空间由满足以下条件的债券构成：

（1）债券种类：在沪深交易所上市的科技创新公司债，不含私募品种，债券币种为人民币；

（2）付息方式：固定利率付息或一次还本付息。

### 2、选样方法

选取样本空间中信用评级符合主体评级AAA，隐含评级AA+及以上的债券作为指数样本。

### 3、指数计算

中证AAA科技创新公司债指数采用派许加权综合价格指数方法计算，计算公式为：

$$\text{报告期指数} = (\text{报告期样本债券总市值} + \text{报告期债券派息}) / \text{除数} \times 100$$

其中，报告期样本债券总市值 =  $\sum [(\text{净价} + \text{应计利息}) \times \text{发行量}]$

该指数计算用价格为中证估值价格，其他计算用基础数据、除数调整参见计算与维护细则。

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

三、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担

基金投资中出现的各类风险，包括：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其他风险等。本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份证券停牌、摘牌或违约等潜在风险，详见本招募说明书“风险揭示”章节。

本基金初始面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

四、投资者应当认真阅读《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者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及申购、赎回对价的交收方式已经认可。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“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，由投资者自行承担。

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。本次招募说明书更新仅涉及基金经理变更相关内容，相关信息更新截止日为2025年11月10日。

## 目 录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 基金管理人 .....	7
第四部分 基金托管人 .....	21
第五部分 相关服务机构 .....	25
第六部分 基金的募集 .....	27
第七部分 基金合同的生效 .....	35
第八部分 基金份额折算 .....	37
第九部分 基金份额的上市交易 .....	38
第十部分 基金份额的申购与赎回 .....	40
第十一部分 基金的投资 .....	54
第十二部分 基金的财产 .....	60
第十三部分 基金资产估值 .....	61
第十四部分 基金的收益与分配 .....	67
第十五部分 基金的费用与税收 .....	69
第十六部分 基金的会计与审计 .....	71
第十七部分 基金的信息披露 .....	72
第十八部分 风险揭示 .....	80
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	88
第二十部分 基金合同的内容摘要 .....	90
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要 .....	91
第二十二部分 对基金份额持有人的服务 .....	92

第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式 .....	93
第二十四部分 备查文件 .....	94
附件一：基金合同内容摘要 .....	95
附件二：托管协议内容摘要 .....	113

## 第一部分 绪言

《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）及其他有关规定以及《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

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

---

## 第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人：指华安基金管理有限公司

3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书：指《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》

9、基金产品资料概要：指《华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

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

11、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《销售办法》：指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对

其不时做出的修订

15、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、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

17、《指数基金指引》：指《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

20、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

21、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

22、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

23、合格境外投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

25、交易型开放式指数证券投资基金：指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”，简称“ETF”

26、ETF 联接基金或联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

27、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资

人

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

29、销售机构：指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协议，办理基金销售业务的机构

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

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

32、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

33、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的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登记业务的机构。本基金登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

34、A 股账户：指深圳证券交易所 A 股账户

35、基金账户：指深圳证券交易所证券投资基金账户

36、证券账户：指 A 股账户和基金账户

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、中国证券登记结算有限责任公司、华安基金管理有限公司发布的其他相关业务规则 and 规定

47、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

48、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

49、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额转换为基金合同约定的赎回对价的行为

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

51、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额和/或其他对价

52、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给该基金份额持有人的现金替代、现金差额和/或其他对价

53、标的指数：指本基金跟踪的基准指数，即中证 AAA 科技创新公司债指数

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

55、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

56、现金替代：指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券的一定数量的现金

57、现金差额：指申购、赎回过程中，最小申购、赎回单位的资产净值与最小申购、赎回单位中的现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现

金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

58、**基金份额参考净值**：指基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据申购、赎回清单等数据计算并通过深圳证券交易所交易时间内发布的基金份额参考净值，简称“IOPV”

59、**预估现金差额**：指申购、赎回过程中，为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额

60、**基金份额折算**：指基金管理人根据基金合同规定在不改变投资者权益的前提下将投资者的基金份额净值及数量进行相应调整的行为

61、**收益评价日**：指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率差额之日

62、**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

63、**元**：指人民币元

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

65、**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

66、**基金资产净值**：指基金资产总值减去基金负债后的价值

67、**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

68、**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

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

70、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 第三部分 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室
- 3、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
- 4、法定代表人：徐勇
- 5、成立日期：1998 年 6 月 4 日
- 6、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
- 7、联系电话：021-38969999
- 8、联系人：王艳
- 9、客户服务中心电话：4008850099
- 10、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
国泰海通证券股份有限公司	51%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	12%
上海锦江国际投资管理有限公司	12%
上海国际集团投资有限公司	5%

#### 三、主要人员情况

- 1、基金管理人董事、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

徐勇先生，博士研究生。曾任上海市人民政府办公厅秘书处调研员，中国太平洋人寿保险股份有限公司党委委员兼中国太平洋人寿保险股份有限公司上海分公司党委书记、总经理，太保安联健康保险股份有限公司党委委员、副总经理，长江养老保险股份有限公司党委副书记、总经理，招商基金管理有限公司党委副书记、总经理、董事。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

钟茂军先生，民建会员，研究生学历，法学硕士、工商管理硕士，现任上海国际集团有限公司董事、总审计师、总法律顾问。历任东方证券股份有限公司投资银行部总经理助理、改制办副主任，上海市金融服务办公室金融机构处副处长、金融稳定处副处长（主持工作）、金融稳定处处长、金融机构服务处处长、市属金融国资监管服务处处长，上海国际集团有限公司运营总监、董事，战略研究部总经理、资本运营部总经理，上海国际集团有限公司董事、运营总监、总法律顾问，兼任上海国有资产经营有限公司监事长。

郭传平先生，硕士研究生学历。历任国泰君安证券哈尔滨西大直街营业部副总经理（主持工作）、总经理（兼齐齐哈尔营业部总经理）、黑龙江营销总部副总经理（主持工作）、总经理、黑龙江分公司总经理、上海市委市政府联席办督查专员助理、国泰君安证券公司业务巡视督导委员会委员、国泰君安期货有限公司党委委员、纪委书记、监事长等职务。现任国泰海通证券公司巡察委员会巡察专员、国泰君安投资管理股份有限公司党委书记、董事长。

顾传政女士，研究生学历。历任中国银行上海市分行职员；上海天道投资咨询有限公司副总经理；毕博管理咨询（上海）公司咨询顾问；上海工业投资集团资产管理有限公司业务主管、总经理助理、副总经理、党支部副书记（主持工作）；上海工业投资（集团）有限公司人力资源部经理、总裁助理、投资部经理、投资研究部总经理等。现任上海工业投资（集团）有限公司党委委员、副总裁。

张羽翀先生，硕士学历，历任锦江国际（集团）有限公司金融事业部常务副总经理，上海锦江国际实业投资股份有限公司首席执行官，锦江国际（集团）有

限公司资产财务部总监。现任锦江国际（集团）有限公司投资总监，上海锦江资产管理有限公司执行董事、总经理，上海锦江国际投资管理有限公司执行董事、首席执行官，建信人寿保险股份有限公司监事。

**独立董事：**

严弘先生，博士研究生学历，教授。历任美国得克萨斯大学奥斯汀分校金融学助理教授、美国南卡罗来纳大学达拉莫尔商学院金融学终身教职、美国证券交易委员会及美国联邦储备局访问学者、长江商学院和香港大学客座教授、亚洲金融学会会刊《金融国际评论》主编。现任上海交通大学上海高级金融学院金融学教授、学术副院长，中国私募证券投资研究中心主任和全球商业领袖学者项目（GES）学术主任。

胡光先生，硕士学历。历任上海胡光律师事务所主任，上海市邦信阳律师事务所合伙人，飞利浦电子中国集团法律顾问，美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师。曾任第十二届、第十三届上海市政协常委、社法委副主任。现任上海市君悦律师事务所主任，兼任国家高端智库武汉大学国际法治研究院兼职研究员，上海市政府行政复议委员会委员，上海仲裁委员会仲裁员，重庆仲裁委员会仲裁员。

吕长江先生，博士研究生学历，教授。现任复旦大学管理学院党委副书记、副院长，教育部长江学者特聘教授。兼任《中国会计评论》共同主编、美国管理会计学会（IMA）中国区学术委员会主任。曾任海通证券股份有限公司、东方财富信息股份有限公司、澜起科技股份有限公司等多家上市公司独立董事。曾获国务院政府特殊津贴、全国先进会计工作者、财政部会计名家、宝钢优秀教师教育奖、复旦大学教学名师奖等荣誉奖项。

陈诗一先生，博士研究生学历，教授。现任复旦大学经济学院教授、复旦大学保险应用创新研究院院长、复旦大学绿色金融研究中心主任。兼任太平再保险（中国）有限公司独立董事、中国数量经济学会副理事长。

**职工董事：**

杨牧云先生，本科学历、硕士学位。历任上海市人民检察院科员，上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

**（2）高级管理人员**

徐勇先生，博士研究生，27年政府、金融行业从业经验。曾任上海市政府办

公厅秘书处调研员，中国太平洋人寿保险股份有限公司党委委员兼中国太平洋人寿保险股份有限公司上海分公司党委书记、总经理，太保安联健康保险股份有限公司党委委员、副总经理，长江养老保险股份有限公司党委副书记、总经理，招商基金管理有限公司党委副书记、总经理、董事。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

张霄岭先生，博士研究生，25年金融、基金行业从业经验。历任美国联邦储备委员会经济学家、摩根斯坦利纽约总部信用衍生品交易模型风险主管、中国银行业监督管理委员会银行监管三部副主任、华夏基金管理有限公司副总经理兼华夏基金（香港）有限公司首席执行官。现任华安基金管理有限公司总经理。

翁启森先生，硕士研究生学历，31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。

杨牧云先生，本科学历、硕士，24年金融法律监管工作经验。历任上海市人民检察院科员，上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

姚国平先生，硕士研究生学历，21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。

范伊然女士，硕士研究生，5年证券、基金行业从业经验。历任洛阳广播电视台记者、主持人，中央电视台新闻中心记者、编导，中国文化遗产研究院（国家水下文化遗产保护中心）副主任，国家文物局政策法规司副司长、国务院新闻办国家文物局新闻发言人（2019年、2020年），国泰君安证券股份有限公司行政办公室品牌中心主任、战略客户部副总经理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

任志浩先生，硕士研究生学历，28年证券、基金行业从业经验。历任原国泰证券、国泰君安证券信息技术部系统开发、维护和分析岗、国泰君安证券交易技

术总监、总经理助理兼创新业务总监、副总经理兼创新业务主管、副总经理兼服务体系开发主管、副总经理兼部门一线合规风控负责人。现任华安基金管理有限公司首席信息官。

## 2、本基金基金经理

周舒展先生，硕士研究生，14年金融、基金行业从业经验。曾任中国银行上海人民币交易业务总部代客交易员、代客组合管理台投资经理、衍生与策略交易台负责人，2020年12月加入华安基金。2021年1月至2025年7月，担任华安锦源0-7年金融债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年3月起，同时担任华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、华安中债7-10年国开行债券指数证券投资基金的基金经理，2021年3月至2025年7月，同时担任华安锦溶0-5年金融债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年3月至2022年11月，同时担任华安安浦债券型证券投资基金的基金经理。2021年7月起，同时担任华安锦灏金融债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年9月至2023年9月，同时担任华安添荣中短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年10月起，同时担任华安添魁债券型证券投资基金的基金经理。2024年8月起，同时担任华安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2025年8月起，同时担任华安上海清算所0-5年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2025年9月起，同时担任华安中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

林唐宇先生，理学硕士，FRM（金融风险管理师），10年相关金融行业从业经验。曾任中国人保资管管理公司债券交易员。2016年3月加入华安基金，历任集中交易部债券交易员，固定收益部基金经理助理。2020年1月至2023年1月，担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2020年1月至2025年7月，担任华安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2020年9月至2022年11月，同时担任华安中债1-5年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2022年11月起，同时担任华安中债1-5年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由华安中债1-5年国开行债券指数证券投资基金转型而来）的基金经理。2020年12月起，同时担任华安锦源0-7年金融债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021年3月至2023年1月，同时担任

华安锦溶 0-5 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 1 月，同时担任华安锦灏金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2025 年 2 月，同时担任华安领荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月起，同时担任华安中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起，同时担任华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

苏卿云先生，硕士研究生，18 年证券、基金行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月至 2021 年 3 月，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 11 月，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 10 月至 2020 年 6 月，同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理，2017 年 10 月起，同时担任华安中证细分医药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。2017 年 12 月至 2022 年 3 月，同时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。2018 年 9 月至 2021 年 3 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月至 2021 年 3 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2022 年 12 月，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 3 月至 2021 年 8 月，同时担任华安沪深 300 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2020 年 6 月，同时担任华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 6 月，同时担任华安中证银行指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起，同时担任华安中证银行交易型开放

式指数证券投资基金联接基金的基金经理（由华安中证银行指数型证券投资基金转型而来）。2021年5月至2022年7月，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年9月至2023年8月，同时担任华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023年8月至2024年9月，同时担任华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。2021年9月起，同时担任华安中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年10月至2024年4月，同时担任华安上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年3月起，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年3月至2023年6月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2023年6月起，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由华安中证全指证券公司指数型证券投资基金转型而来）的基金经理。2022年4月至2023年11月，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022年5月起，同时担任华安上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月起，同时担任华安中债1-5年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年9月起，同时担任华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年10月至2023年11月，同时担任华安中证上海环交所碳中和指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023年4月起，同时担任华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年6月起，同时担任华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年9月起，同时担任华安中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年11月起，同时担任华安中证全指软件开发交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年1月起，同时担任华安中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年3月起，同时担任华安中证全指软件开发交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年6月起，同时担任华安上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年

11 月起，同时担任华安中证全指医疗器械指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起，同时担任华安中证全指计算机指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月起，同时担任华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

### 3、投决会信息：

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：

张霄岭先生，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，任首席指数投资官、总经理助理、兼指数与量化投资部高级总监

贺涛先生，联席首席固收投资官

苏圻涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，联席首席权益投资官，兼任投资研究部联席总监

邹维娜女士，首席固收投资官

胡宜斌先生，联席首席权益投资官

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 5、业务人员的准备情况：

截至 2025 年 9 月 30 日，公司目前共有员工 545 人(不含子公司)，其中 74.7% 具有硕士及以上学历，92.8% 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、IT 运营、综合行政、合规风控等五个业务板块组成。

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

- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，编制申购、赎回清单；
- 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权益；
- (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、岗位责任、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应措施,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；会计账务的组织和处理制度。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。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2024 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 10.51 万亿元，实现营业收入 2122.26 亿元，同比增长 0.66%，实现归属于母公司股东的净利润 772.05 亿元。开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

#### 二、托管业务部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、证券投资基金处、信托保险处、理财私募处、需求支持处、稽核监察处、投资监督处、运行管理处，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2025 年 6 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 809 只，托管基金的基金资产净值合计 27790.02 亿元，基金份额合计 25239.73 亿份。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

##### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### （二）内部控制组织结构

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

##### （三）内部控制原则

- 1、全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；
- 2、重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；
- 3、独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；
- 4、审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；
- 5、制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；
- 6、适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

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

#### （四）内部控制制度及措施

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

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

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

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

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

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

#### 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

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

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

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

监会报告。

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、网下现金发售和网下债券发售机构

详见基金份额发售公告。

#### 2、网上现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深圳证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并在基金管理人网站公示。基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：0755-25941405

传真：0755-25987133

联系人：丁志勇

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：陈颖华

经办律师：安冬、陈颖华

#### 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

法定代表人：邹俊

联系电话：010-85085000

传真：010-85185111

联系人：虞京京

经办注册会计师：虞京京、欧梦激

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金的设立及其依据

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 2025 年 9 月 8 日证监许可【2025】1991 号文注册募集。

### 二、基金的类别、运作方式、标的指数及存续期限

基金类型：债券型证券投资基金

基金运作方式：交易型开放式

标的指数：中证 AAA 科技创新公司债指数

基金存续期限：不定期

### 三、募集期限

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

募集期内，本基金同时对符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者进行发售。

如果在此期间未达到本招募说明书第七部分第一款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

### 四、募集场所

本基金通过基金销售机构（包括基金管理人的直销机构及其他销售机构，具体名单见基金份额发售公告或基金管理人网站的公示）公开发售。

### 五、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合

格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## 六、募集目标

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

如本基金设置募集规模上限的，具体规模上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。

## 七、基金份额初始面值、认购价格

基金份额的初始面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

## 八、发售方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。网下债券认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告、后续调整发售机构的公告或基金管理人网站的公示。

基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在基金份额发售公告或相关公告中列明。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

## 九、认购开户

1、投资者认购本基金时需持有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深圳 A 股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳基金账户”）。

2、账户使用注意事项:

(1) 如投资人需要参与网下现金或网上现金认购, 应使用深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户; 深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

(2) 如投资者需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回, 则应开立和使用深圳 A 股账户。

十、认购费用

认购费用由投资者承担, 认购费率不高于 0.40%, 认购费率如下表所示:

认购份额 (S, 份)	认购费率
$S < 50$ 万	0.40%
$50 \text{ 万} \leq S < 100 \text{ 万}$	0.20%
$S \geq 100 \text{ 万}$	按笔收取, 500 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下债券认购时按照上表所示费率收取认购费用。基金管理人在投资者提交认购申请时以现金方式向投资者收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购时可参照上述费率结构, 按照不超过 0.4% 的标准收取一定的佣金。投资者申请重复现金认购的, 须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

十一、网上现金认购

1、认购时间

详见基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算

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

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

(或若适用固定费用的, 认购佣金=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

(或若适用固定费用的, 认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

总认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额初始面值

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取,投资者需以现金方式交纳认购佣金。网上现金认购在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

例:某投资者通过某发售代理机构采用网上现金方式认购 1,000 份本基金,假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.40%,假定认购金额产生的利息为 1 元,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=1.00×1,000×0.40%=4.00 元

认购金额=1.00×1,000×(1+0.40%)=1004.00 元

该投资者所得认购份额为:

总认购份额=1,000+1/1.00=1,001.00 份

即投资者采用网上现金方式认购,需准备 1004.00 元资金,方可认购到 1,000 份本基金基金份额。假定该笔认购金额产生的利息为 1 元,则投资者实际可得到 1,001.00 份基金份额。

### 3、认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限,但除基金合同另有约定外。

投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

### 4、认购手续

投资者在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。投资者可多次申报,不可撤单,申报一经确认,认购资金即被冻结。

### 5、清算交收

投资者提交的认购申请,由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

### 6、认购确认

在基金合同生效后,投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

## 十二、网下现金认购

### 1、认购时间

详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人或指定发售代理机构确定。

## 2、认购金额和利息折算的份额的计算

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

$$\text{认购费用} = \text{基金份额初始面值} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{基金份额初始面值} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

(或若适用固定费用的，认购金额=基金份额初始面值×认购份额+固定费用)

$$\text{总认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{基金份额初始面值}$$

认购费用由基金管理人在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

网下现金认购在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人或登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资者通过基金管理人采用网下现金方式认购本基金 800,000 份，认购费率为 0.20%，假定认购金额产生的利息为 100 元，则该投资者的认购金额为：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 800,000 \times 0.20\% = 1,600.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 800,000 \times (1 + 0.20\%) = 801,600.00 \text{ 元}$$

该投资者所得认购份额为：

$$\text{总认购份额} = 800,000 + 100 / 1.00 = 800,100 \text{ 份}$$

即，若该投资者通过基金管理人采用网下现金方式认购本基金 800,000 份，则该投资者的认购金额为 801,600.00 元，假定该笔认购金额产生的利息为 100 元，则可得到 800,100 份基金份额。

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

## 3、认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购

的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，但基金合同另有约定除外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

#### 4、认购手续

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

#### 5、清算交收

通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

#### 6、认购确认

基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

### 十三、网下债券认购

#### 1、认购时间

详见基金份额发售公告，具体业务办理时间由基金管理人或指定发售代理机构确定。

#### 2、认购限额

网下债券认购以单只债券张数申报，用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券。单只债券最低认购申报张数为 100 张，超过 100 张的部分须为 10 张的整数倍。投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单笔认购份额须在 50 万份以上（含 50 万份）。投资者可以多次提交认购申请，累计申报张数不设上限。

#### 3、认购手续

投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购债券。网下债券认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

#### 4、特殊情形

（1）已公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

(2) 限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前 3 个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。

(3) 临时拒绝个券认购：对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

(4) 募集结束前，如标的指数成份券出现调整，则调入名单中的债券将也纳入认购清单。

## 5、清算交收

发售代理机构、基金管理人将按照登记机构相关规定办理网下债券认购的清算交收。基金合同生效后，登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记。

## 6、认购份额的计算公式

投资者的认购份额 =  $\sum_{i=1}^n$  (第 i 只债券的价值 × 有效认购数量) / 1.00

其中：

(1) i 代表投资人提交认购申请的第 i 只债券，如投资人仅提交了 1 只债券的申请，则 i=1。

(2) “第 i 只债券的价值” = 第 i 只债券在 T 日的估值价（注：如无特别所指，则为估值净价）+ 截至（D-1）日应计利息。

若某一债券在 T 日至登记机构进行债券过户日（D 日）的冻结期间发生利息兑付等权益变动情况，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将相应调整应计利息的计算。

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的债券数量。其中：

①若基金管理人在网下债券认购日前公告了限制认购规模的个券名单，则对于经公告限制认购规模的个券，基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在届时公告中列示。

②若某一债券在网下债券认购日至登记机构进行债券过户日（D 日）的冻结期间发生司法执行，则基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资人的有

效认购数量进行相应调整。

7、在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

(1) 若投资人选择以现金方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购佣金} = \text{基金份额发售面值} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额}$$

(2) 若投资人选择以基金份额的方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购佣金} = \text{基金份额发售面值} \times \text{认购份额} / (1 + \text{佣金比率}) \times \text{佣金比率}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金} / 1.00$$

认购份额、净认购份额和以基金份额的方式支付认购佣金的计算保留到整数位，小数点后部分舍去。

#### 十四、募集资金利息与募集债券权益的处理方式

网上现金认购和网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；投资者以债券认购的，募集期间认购债券由发售代理机构予以冻结。投资者的认购债券在募集冻结期间产生的权益归属依据相关规则办理。

#### 十五、募集期间的资金、债券与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的债券按照证券交易所和登记机构的规则和流程办理债券的冻结和过户。

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

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。网下债券认购所募集的债券按照《业务规则》办理冻结和过户。

### 二、基金合同不能生效时募集资金及债券的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；网下认购所募集债券的解冻按照《业务规则》的规定处理；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中

国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额折算和变更登记

为提高交易便利或根据需要,基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记,且无需召开基金份额持有人大会。基金份额折算后,基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除计算过程中涉及的尾数保留外,基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后,基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告,并提前以书面形式通知基金托管人。基金成立后,在适当的时候,在基金管理人与基金托管人协商一致的情况下,本基金可实施基金份额拆分或合并,且无需召开基金份额持有人大会。

## 第九部分 基金份额的上市交易

### 一、基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市：

- 1、基金募集金额（含网下债券认购所募集的债券市值）场内不低于 2 亿元；
- 2、基金份额持有人场内不少于 1000 人；
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

### 二、基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

### 三、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市等按照《基金法》和相关法律法规以及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关业务规则、通知、指引、指南等有关规定执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关规定所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金可由交易型开放式指数证券投资基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，而无需召开基金份额持有人大会审议。基金终止上市后，场内份额的处理规则，由基金管理人提前制定并公告。

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

#### 四、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金上市交易后，基金管理人将根据基金的运作情况决定是否进行本基金基金份额参考净值的计算与公告，并将提前公告。

基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式和公告方式，并予以公告。

五、相关法律法规、中国证监会、登记机构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。

六、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。

七、在不违反法律法规且不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

## 第十部分 基金份额的申购与赎回

未来在条件允许的情况下，基金管理人可以开通本基金的场内现金申购、赎回以外的申购、赎回方式，或者场外申购、赎回等业务，相关申购赎回的适用条件、业务办理时间、业务规则、申购赎回原则、申购赎回费用等相关事项届时将另行约定并公告。

### 一、申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，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以及基金管理人接受办理申购、赎回业务的其他时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依

照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金在上市交易之前可开始办理申购、赎回。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购、赎回。

### 三、申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、本基金申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、本基金申购赎回应遵守业务规则的规定。
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回申请的提出

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

投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的申购对价，否则申购不成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则赎回不成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

#### 2、申购和赎回申请的确认

投资人的申购、赎回申请在受理后由登记机构进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败；如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

基金销售机构受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申

购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T日内对该交易的有效性进行确认。投资人应及时查询有关申请的确认情况，否则如因申请未得到登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。

根据本基金现行适用的清算交收和申赎处理规则，投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后可卖出或赎回，即T日申购的ETF份额且日间完成实时逐笔全额结算（Real Time Gross Settlement，简称RTGS）交收的，T日可卖出或赎回，而T日申购的ETF份额且日终完成逐笔全额非担保交收的，T+1日方可卖出或赎回；T日竞价买入的基金份额，T日可以卖出或赎回。

若深圳证券交易所和登记机构推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人将根据新的业务规则新增或调整申购和赎回申请的确认方式，无须召开基金份额持有人大会审议。

### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购和赎回过程中涉及的申购赎回对价和基金份额的交收适用业务规则的规定。本基金申购业务采用RTGS模式；赎回业务中的现金替代采用代收代付处理；申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付处理。

投资者T日申购成功后，正常情况下，登记机构在T日为投资者办理基金份额与现金替代等的交收，在T+2日内办理现金差额的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。

投资者T日赎回成功后，正常情况下，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的交收，在T+2日内办理现金差额的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。

赎回替代款的清算交收由基金管理人和申购赎回代理券商协商处理，正常情况下，该款项的清算交收于T+7日内办理，但如果出现基金投资/上市市场交易清算规则发生较大变化、休市、基金赎回数额较大或基金组合内的部分投资品种因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出等情况，则赎回款项的清算交收可延迟办理。

对于因申购赎回代理券商交收资金不足，导致投资人现金申购失败的情形，

按照申购赎回代理券商的相关规则处理。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据业务规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

如深圳证券交易所、登记机构修改或更新上述规则或规定并适用于本基金的，则按照新的规则或规定执行，并在本招募说明书中进行更新。

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

## 五、申购和赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍，最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整。本基金最小申购、赎回单位请见届时发布的相关公告或申购赎回清单。本基金基金份额折算的，最小申购赎回单位相应调整。

2、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购和赎回份额的数量限制，包括当天净申购和净赎回上限、单个证券账户当天净申购和净赎回上限、当天累计可申购和累计可赎回上限、单个证券账户当天累计可申购和累计可赎回上限等，并在申购、赎回清单中公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购上限、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。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回份额的数量限制或增加其他限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付的现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

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

## 七、申购、赎回清单的内容与格式

### 1、申购、赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。如深圳证券交易所修改或更新申购赎回清单的内容、参数计算方法并适用于本基金的，则按照新的规则执行。

### 2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购、赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购、赎回单位所对应的成份证券的必须现金替代与可以现金替代金额之和，赎回替代金额固定为0。

### 3、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购、赎回清单将

公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

#### 4、现金替代相关内容

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

采用现金替代是为了便利投资者的申购赎回、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

(1) 现金替代分为 2 种类型：可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

可以现金替代是指允许使用现金作为该成份证券的替代，替代金额按代理买卖原则确定。

必须现金替代是指该成份证券必须使用现金替代。

##### (2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券是指基金管理人认为需要代投资人买入或卖出的证券。

##### ②申购对应的替代金额：

申购对应的替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 申购现金替代保证金率)

对于可以现金替代的证券，基金管理人需代投资者买入，该证券实际结算成本与参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定申购现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

该证券参考价格的确定原则（下同）：

该证券参考价格 = 该证券 T-1 日估值价（注：如无特别所指，则为估值净价） + T 日应收利息。

根据债券市场的活跃度和流动性情况变化，基金管理人可调整“该证券参考价格”的确定原则，并在实施日前公告。

### ③申购对应的替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日申购申请，基金管理人将在 T+2 日内以收到的替代金额买入被替代证券。T+2 日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用）和未买入的被替代证券的 T+2 日估值全价（即 T+2 日的估值价与 T+2 日应收利息之和，T+2 日无估值价的，取最近一次估值价与估值日应收利息之和）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购对应的替代金额确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，若 T 日后至 T+2 日期间发生付息、还本等变动，则进行相应调整。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入被替代证券的操作。正常情况下，T+7 日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理券商办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

### ④赎回对应的替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请，基金管理人将在 T+2 日内根据赎回情况代理卖出被替代证券。T+2 日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的 T+2 日估值全价（即 T+2 日的估值价与 T+2 日应收利息之和，T+2 日无估值价的，取最近一次估值价与估值日应收利息之和）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回对应的替代金额，若 T 日后至 T+2 日期间发生付息、还本等变动，则进行相应调整。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不卖出部分被替代证券，或者不进行任何卖出被替代证券的操作。正常情况下，T+7 日内，基金管理人将应支付的赎回对应的替代金额与相关申购赎回代理券商办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇证券交易场所临时停市等特殊情况，组合证券的代理买入或者卖出及结算价格可依次顺延至下一交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致价格不公允的特殊情况，可对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券恢复交易后价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护基金份额持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其恢复交易后按照实际交易成本办理。

登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

### (3) 必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。

固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以该证券参考价格或基金管理人认为合理的方法。

### 5、预估现金差额相关内容

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

预估现金差额的计算公式为：

$T$ 日预估现金差额= $T-1$ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值-(申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与该证券参考价格乘积之和)

另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

### 6、现金差额相关内容

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

$T$  日现金差额= $T$  日最小申购、赎回单位的资产净值-(申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日估值全价乘积之和)

其中， $T$  日估值全价为该证券  $T$  日估值价与  $T$  日应收利息之和。

$T$  日投资者申购、赎回基金份额时，需按  $T+1$  日公告的  $T$  日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。

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

7、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息：

最新公告日期	202X-XX-XX
基金名称	华安中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华安基金管理有限公司
基金代码	XXXXXX
目标指数代码	XXXXXX
基金类型	XXXXXX

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）	
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	
基金份额净值（单位：元）	

T 日信息内容

预估现金差额（单位：元）	XX.XX
可以现金替代比例上限	XX%
是否需要公布 IOPV	否
最小申购、赎回单位（单位：份）	XXXX
最小申购、赎回单位现金红利（单位：元）	0
本市场申购赎回组合证券只数	
全部申购赎回组合证券只数	

是否开放申购	是
是否开放赎回	是
当天净申购的基金份额上限	不设上限
当天净赎回的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天净申购的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限	不设上限
当天累计可申购的基金份额上限	不设上限
当天累计可赎回的基金份额上限	XXXXXX
单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限	不设上限
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限	不设上限

注：申购、赎回清单的格式可根据深圳证券交易所的系统升级相应调整，具体格式以深圳证券交易所提供的清单模版为准，届时不再另行公告。

成份券信息内容：

证券代码	证券简称	债券数量	现金替代标志	申购现金替代保证金率	赎回现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场

说明：此处为示例。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；
- 3、证券、期货交易所临时停市或交易时间非正常停市，基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；
- 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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

6、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单；

7、因异常情况导致申购、赎回清单无法编制或编制不当，或基金份额参考净值（IOPV）计算错误；

8、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购；

9、在发生标的指数成份券发行人重大行为（如兼并重组）、成份券市场价格异常波动等异常情形时；

10、申请超过基金管理人设定的基金总规模上限、单日净申购上限、单个投资者单日或单笔申购份额上限的；

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

12、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时；

13、法律法规规定、深圳证券交易所或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4、10 项外暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价；

2、证券、期货交易所临时停市或交易时间非正常停市，基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易；

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受

基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回对价；

4、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回；

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

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

7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请；

8、法律法规规定、深圳证券交易所或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 5 项以外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对价时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。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、其他申购赎回方式

1、ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出联接基金，在本基金开放申购赎回之前，联接基金可以特殊申购本基金基金份额。

2、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，在履行适当程序后调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前予以公告。

3、在条件允许且履行适当程序后，基金管理人可开放集合申购，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人有权制定集合申购相关的

具体业务规则。

4、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议并公告。

5、未来在条件允许且履行适当程序后，基金管理人可以开通本基金的场内现金申购、赎回以外的申购、赎回方式，或者场外申购、赎回等业务，相关业务的适用条件、业务办理时间、业务规则等相关事项届时将另行约定并公告。

## 十一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。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，或按法律法规或有权机关规定的方式处理。

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

## 十二、基金的登记和转托管

### 1、基金份额的登记

本基金场内份额由中国证券登记结算有限责任公司负责办理登记结算。

### 2、基金份额的转托管

转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。

登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

### 十三、基金份额的冻结和解冻

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

### 十四、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### 十五、基金清算交收与登记模式的调整或新增

若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式指数证券投资基金修改现有的清算交收与登记模式或推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对招募说明书予以更新，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十一部分 基金的投资

### 一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于本基金非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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，本基金的投资比例会做相应调整。

### 三、投资策略

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构

造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### 1、债券投资策略

本基金主要采取债券指数化投资策略，采用抽样复制和动态最优化的方法，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金通过对标的指数中各成份券的久期、剩余期限、信用资质、流动性及到期收益率等进行分析，构建与标的指数风险收益特征相似的投资组合，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，力争弥补基金费用等管理成本，尽量缩小与标的指数的偏离度。当市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致部分标的指数成份券无法满足投资需求时，基金管理人可通过投资其他债券等方式进行替代。

#### 2、国债期货投资策略

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。

#### 3、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。

今后，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围。随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### 四、投资限制

#### （一）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于本基金非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种不受此条款规定的比例限制；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种不受此条款规定的比例限制；

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

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(10) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金如投资于国债期货，还应遵循如下投资组合限制：

①在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

②本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

③本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不

得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

④本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于债券投资比例的有关约定；

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

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

（14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）（9）（12）（13）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，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。

## （二）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

### (三) 关联交易

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

法律法规或监管部门取消或调整上述规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证 AAA 科技创新公司债指数收益率。

本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

因此，本基金业绩比较基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

## 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，

具有与标的指数相似的风险收益特征。

七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

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

2、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 第十二部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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

基金所拥有的债券、国债期货合约、银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，

使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

1、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

2、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、本基金投资国债期货合约，一般以国债期货合约估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

对方，共同查明原因，双方协商解决。

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

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报

基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

(3) 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，由此给基金份额持有人造成损失的，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过错程度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对价等），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。

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

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、不可抗力；

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、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 八、基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券、期货交易所、登记机构、指数编制机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误或由于其他不可抗力等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式为现金分红；

2、在符合以下基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配：

(1) 本基金每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于0元时，基金管理人可进行收益分配；

(2) 当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

### 二、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

### 三、收益分配方案的确定、公告与实施

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

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红

利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### 四、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

#### 五、基金收益分配数额的确定

##### (1) 基金相对业绩比较基准的超额收益率计算

在基金收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、业绩比较基准同期累计报酬率。

基金收益评价日本基金相对业绩比较基准的超额收益率=基金累计报酬率-业绩比较基准同期累计报酬率

基金累计报酬率=收益评价日基金份额净值（如基金上市后基金份额发生折算，则采用剔除折算因素的基金份额净值）/基金上市前一个交易日基金份额净值-100%

业绩比较基准同期累计报酬率=收益评价日业绩比较基准数值/基金上市前一个交易日业绩比较基准数值-100%

(2) 根据前述收益分配原则计算截至收益分配评价日本基金的基金份额可分配收益，并确定收益分配比例。

(3) 每基金份额的应分配收益为基金份额可分配收益乘以收益分配比例，保留小数点后 3 位，小数点后第 4 位舍去。

## 第十五部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用及结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市费及年费；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，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、标的指数许可使用费。本基金标的指数许可使用费由基金管理人支付。
- 2、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；
- 3、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；
- 4、《基金合同》生效前的相关费用；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

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

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金

信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在

基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

根据投资需要或为提高交易便利，基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金管理人确定基金份额折算日后应按照相关法律法规的要求将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应按照相关法律法规的要求将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

（五）基金份额上市交易公告书

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

（六）基金净值信息

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前且开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

（七）基金份额申购、赎回对价

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份

额申购、赎回对价的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （八）申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、申购赎回代理券商以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

#### （九）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （十）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、基金管理费、基金托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 19、基金变更标的指数；

- 20、基金份额上市交易、停牌复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 21、调整最小申购、赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- 22、本基金变更份额类别设置；
- 23、基金推出新业务或服务；
- 24、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

#### （十一）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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十二）澄清公告

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

#### （十三）投资国债期货相关公告

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。

#### （十四）投资资产支持证券的相关公告

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

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

#### （十五）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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

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

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

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及自律规则的相关规定。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、深圳证券交易所，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、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、不可抗力；

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。

## 第十八部分 风险揭示

本基金的风险主要包括：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、本基金特定风险及其他风险等。

### 一、系统性风险

本基金投资于证券市场，系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险和购买力风险等。

#### 1、政策风险

政策风险是指政府有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的举措、法规出台，引起债券价格的波动，从而给投资带来的风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本，并在一定程度上影响发行人的盈利水平。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

#### 5、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，这与利率上升带来的价格风险互为消长。在利率走低时，再投资收益率就会降低，再投资的风险加大。当利率上升时，债券价格会下降，但是利息的再投资收益会上升。

## 二、非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括信用风险等。

债券发行人无法按时还本付息，而使投资遭受损失的风险为信用风险。这种风险主要表现在公司债券中，公司如果因为某种原因不能完全履约支付本金和利息，则债券投资就会承受较大的亏损。广义的信用风险不仅指企业的违约风险，还包括市场信用利差扩大及企业信用评级下降的风险。

## 三、管理风险

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

## 四、流动性风险

### 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货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）。

一般情况下，上述投资标的流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况，如因成份券流动性严重不足等特殊情形导致基金无法完全投资于成份券时，基金管理人将根据市场情况，并结合经验判断，采取包括成份券替代策略等在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期有效控制本基金的流动性风险。

### 2、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

本基金备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付

赎回对价、暂停基金估值以及证监会认定的其他措施。

暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价等工具的情形、程序见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”的相关规定。若本基金暂停赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。若本基金延缓支付赎回对价，赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

暂停基金估值的情形、程序见招募说明书“第十三部分 基金资产估值”的相关规定。若本基金暂停基金估值，基金将暂停接受申购赎回申请或延缓支付赎回对价，将导致投资者无法申购或赎回本基金，或赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

3、对ETF基金投资人而言，ETF可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

## 五、本基金特定风险

### 1、标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份债券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

### 2、标的指数波动的风险

标的指数成份债券的价格可能受到政治因素、经济因素、发行人经营状况、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、标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异，从而使基金收益发生变化。同时，中证指数有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出现错误，投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

### 4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份券或变更编制方法或标的指数成份券在标的指数中的权重发生变化或成份券流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素，可能导致本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

本基金采用抽样复制和动态最优化策略，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离。

#### 5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

(1) 由于标的指数调整成份券或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中导致跟踪偏离。

(2) 由于成份券暂停上市、停牌、摘牌、违约或流动性不足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导致跟踪偏离。

(3) 因缴纳相关税款，可能导致基金实际收到的利息金额低于票面利息金额，从而影响利息再投资收益，利息再投资可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而导致跟踪偏离。

(4) 基金的证券交易成本以及基金管理费和托管费可能导致跟踪偏离。

(5) 基金管理人的管理能力会对本基金的收益产生影响，从而导致跟踪偏离。

(6) 基金现金资产的拖累会影响本基金对标的指数的跟踪。

(7) 本基金采用优化抽样复制策略，基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与标的指数收益率产生偏离。

(8) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入债券数的限制，基金组合中个别债券的持有比例与标的指数中该债券的权重可能存在差异、基金申购与赎回带来的现金变动、指数编制机构指数编制错误。

#### 6、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会

进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 7、成份券停牌或违约的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌或发生违约，发生成份券停牌或违约时可能面临如下风险：

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 在极端情况下，标的指数成份券可能大面积停牌或违约，基金可能无法及时卖出成份券以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 8、成份券退市、摘牌或违约的风险

指数成份券可能面临退市、摘牌或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券的退市或违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，并对投资组合进行相应调整。

#### 9、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，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的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标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 10、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 11、套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此存在一定的套利风险。

#### 12、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金上市交易后，基金管理人将根据基金的运作情况决定是否进行本基金基金份额参考净值的计算与公告，并将提前公告。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

#### 13、退市风险

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

#### 14、投资人申购赎回失败的风险

投资人在提出申购、赎回申请时，如不具备足额的符合条件的申购、赎回对价，可能导致申购、赎回失败的情形。

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

基金还可能在申购、赎回清单中设定申购份额上限（或赎回份额上限），如果投资者的申购（或赎回）申请接受后将使当日申购（或赎回）份额超过申购份额上限（或赎回份额上限），则投资者的申购（或赎回）申请可能失败。

#### 15、本基金投资特定品种的特有风险

##### （1）国债期货的投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

## (2) 资产支持证券的投资风险

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券的投资与基金资产密切相关，因此会受到特定原始权益人破产风险及现金流预测风险等的影响；当本基金投资的资产支持证券信用评级发生变化时，本基金将需要面对临时调整持仓的风险；此外当资产支持证券相关的发行人、管理人、托管人等出现违规违约时，本基金将面临无法收取投资收益甚至损失本金的风险。

## 六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## 七、其他风险

### 1、技术风险

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

### 2、道德风险

由于人员的机会主义行为等主观因素带来的风险，如内幕交易、欺诈、舞弊等行为可能给基金资产带来直接损失或损害基金管理人声誉从而损害本基金投资人利益。

### 3、合规风险

由于操作疏忽、制度不健全或者外部法律法规环境变化等原因造成基金运作违反相关规定的风险。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、类属配置不符合基金合同的要求；也可能表现在个券的选择不符合本基

金的投资风格和投资目标等。

#### 4、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产遭受损失；同时，证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金在开放期内正常申购和赎回的风险。

#### 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，本基金还通过销售机构销售。但是，本基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议需报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

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

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 第二十一部分 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。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目。

基金管理人提供的服务内容如下：

### 1、客户服务热线

客服热线自动语音系统提供 7\*24 小时的自动语音服务和查询系统，投资者可通过电话收听最新公告、基金份额净值等信息。客服热线人工服务在交易日提供人工咨询服务，一对一为投资者解答基金投资疑问。

华安客户服务热线：40088-50099。

### 2、网上服务

投资者可以通过登录网站，查询基金相关资料等信息。

### 3、客户投诉处理

投资者可以通过基金管理人提供的客服热线投诉处理专席、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人提供的服务进行投诉。投资者还可以通过发售代销机构、申购赎回代理券商的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

### 4、网址及电子信箱

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

电子信箱：[service@huaan.com.cn](mailto:service@huaan.com.cn)

5、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。

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书（包括更新的招募说明书）存放在基金管理人、基金托管人、基金销售机构的住所，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。

## 第二十四部分 备查文件

### 一、备查文件

1、中国证监会对华安中证 AAA 科技创新公司债指数证券投资基金的募集作出准予注册的文件

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、指数授权协议

8、注册登记协议

9、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：投资者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

二〇二五年十一月十一日

## 附件一：基金合同内容摘要

### 第一节 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 一、基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项和认购债券、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金管理人

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 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；
- (14) 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；
- (15) 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、转托管等方面的业务规则；
- (16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购、赎回清单；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关提供或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

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

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，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(税后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;投资者以债券认购的,相关债券的解冻按照《业务规则》的规定处理;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 三、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,

确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

(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不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会

和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 第二节 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

### 一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率或变更收费方式；
- (3) 增加、减少或调整基金份额类别及定义；

- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则；
- (7) 本基金推出新业务或新服务；
- (8) 调整申购赎回清单的内容，调整基金份额净值、申购、赎回清单的计算和公告时间或频率；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的, 基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一); 若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

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

3、在不违反法律法规或监管机构规定的情况下, 经会议通知载明, 基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开, 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。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## 七、计票

### 1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，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。

### 第三节 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议需报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新

基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

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

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

#### 5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

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

### 第四节 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金基金合同之目的，不包括香港特别行政

区、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖。

### 第五节 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

### 第一节 基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室

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

成立时间：1998 年 6 月 4 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

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：人民币 1.5 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金设立，基金业务管理及中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

#### （二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

注册地址：福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号

邮政编码：350013

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行银复〔1988〕347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字〔2005〕74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行保险监督管理委员会批准的其他业务；保险兼业代理业务；黄金及其制品进出口；公募证券投资基金销售；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）。

## 第二节 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

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

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部

分除外)、可交换债券。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于本基金非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

当法律法规或监管机构的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述投资比例进行适当调整。

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

1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于本基金非现金基金资产的80%;

2、本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;

3、本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种不受此条款规定的比例限制;

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种不受此条款规定的比例限制;

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

6、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

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

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

10、本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

11、本基金如投资于国债期货，还应遵循如下投资组合限制：

(1) 在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

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

(3) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(4) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于债券投资比例的有关约定；

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

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

14、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述 2、9、12、13 情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，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。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条规定的基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司名单，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人及基金托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人及基金托管人应及时发送另一方，另一方于2个工作日内进行确认已知名单的变更。一方收到另一方书面确认后，新的关联交易名单开始生效。

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

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

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易，如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

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

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、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。

（六）基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1、基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金

银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2、基金管理人应当按照有关法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关相关法规及协议对基金银行存款业务进行监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

4、基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供存款银行名单的，视为基金管理人认可所有银行。基金管理人未根据有关法律法规的规定及基金合同的约定对定期存款提前支取的，损失由其承担。

(七)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

(八)基金管理人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。

(九)若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人。

(十)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。

### 第三节 基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户及投资所需的其他账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金管理人及基金财产因此所遭受的损失。

(三)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。

基金管理人基于正当合理理由可定期和不定期地对基金托管人保管的基金

财产进行核查。

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。

#### 第四节 基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2.基金托管人应安全保管基金财产。
- 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、期货结算账户及投资所需的其他账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立运作，分开核算，确保基金财产的完整与独立。
- 5.基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）结算数据完成场内交易交收、基金资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
- 6.对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担相应责任。
- 7.除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金募集期间及募集资金、债券的验资

- 1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2.基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含

网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值)、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,募集的债券由登记机构予以冻结,并由登记机构过户至本基金的证券账户。同时在规定时间内,基金管理人应聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜,基金托管人应提供充分协助。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券,按照《业务规则》的规定处理,基金管理人不承担相关债券冻结期间交易价格波动的责任。

### (三) 基金银行账户的开立和管理

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

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

3. 托管资金账户的管理应符合有关法律法规的规定。

### (四) 定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户,包括实体或虚拟账户,其预留印鉴经各方商议后预留。在取得存款证实书后,基金托管人保管证实书正本或者复印件。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜,若基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款,若产生息差(即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额),该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

对于任何的定期存款投资,基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议,约定双方的权利和义务,该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条

款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。

#### （五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户、持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中登公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

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

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中登公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中登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、结算互保金、交收价差资金等的收取按照中登公司的规定执行。

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

#### （七）期货资金账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在期货交易所以获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

#### （八）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人与基金托管人协商后由基金托管人负责办理。新账户按有关规定使

用并管理。

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定。

(九) 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、中登公司上海分公司/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、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对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。

(十) 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将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不少于法定最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件或复印件，未经双方协商一致或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由基金管理人保管。

## 第五节 基金资产净值计算和会计核算

(一) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

### 1.基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的

余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此造成的误差归入基金资产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

## 2. 复核程序

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

### (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1. 估值对象

基金所拥有的债券、资产支持证券、国债期货合约、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产及负债。

#### 2. 估值方法

(1) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值；

(2) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；

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

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

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(6)本基金投资国债期货合约,一般以国债期货合约估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的,从其规定。

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

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

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

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

### (三) 基金份额净值错误的处理方式

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

#### 1. 估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

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

#### 2. 估值错误处理原则

(1)估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3. 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4. 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托

管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 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，由此给基金份额持有人造成损失的，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过错程度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对价等)，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。

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

#### (四) 暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.不可抗力；

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.法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 基金账册的建立

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

(七) 基金财务报表与报告的编制和复核

1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2. 报表复核

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

3. 财务报表的编制与复核时间安排

(1) 报表的编制

基金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。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。基金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。

## 第六节 基金收益分配

### （一）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式为现金分红；

2、在符合以下基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配：

（1）本基金每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于0元时，基金管理人可进行收益分配；

（2）当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

### （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

#### （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

#### 第七节 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保存期不低于法定最低期限。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，保存期限不低于法定最低期限。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

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

#### 第八节 托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。

##### （二）基金托管协议终止的情形

- 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。

##### （三）基金财产的清算

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

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

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

7、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。

8、基金财产清算剩余资产的分配

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

9、基金财产清算的公告

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

## 10、基金财产清算账册及文件的保存

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

### 第九节 争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方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。

本协议受中国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。