

**上证 50 交易型开放式指数证券投资基金  
招募说明书（更新）  
2024 年 11 月 28 日公告**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

上证50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2004年11月22日证监基金字[2004]196号文批准募集。本基金基金合同于2004年12月30日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，本基金的特定风险等。本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等风险。本基金可开展集合申购业务，允许投资者以单只或多只成份券为对价申购本基金。参与集合申购业务的投资者将面临集合申购业务的风险，包括投资者集合申购失败的风险、集合申购组合调整的风险、基金份额无法卖出或赎回的风险、基金管理人代为赎回基金份额的风险、投资者需要补缴款项的风险等，具体详见本招募说明书中“风险揭示”章节。本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 50 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

**投资者应当认真阅读并完全理解基金合同规定的免责条款和规定的争议处理方式。**

本招募说明书更新有关财务数据和净值表现数据截止日为**2024年3月31日**（如本基金未披露**2024年1**季报，则本次更新暂无相关投资组合报告和业绩数据），主要人员情况截止日为**2024年11月27日**。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

更新事项：调整基金经理。

## 目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	5
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集.....	36
七、基金合同的生效.....	36
八、基金份额折算与变更登记.....	36
九、基金份额的上市交易.....	37
十、基金份额的申购与赎回.....	37
十一、基金的投资.....	50
十二、基金的业绩.....	61
十三、基金的财产.....	64
十四、基金资产的估值.....	64
十五、基金的收益与分配.....	68
十六、基金的费用与税收.....	69
十七、基金的会计与审计.....	70
十八、基金的信息披露.....	71
十九、风险揭示.....	76
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	82
二十一、基金合同的内容摘要.....	84
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	94
二十三、对基金份额持有人的服务.....	99
二十四、其他应披露事项.....	100
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	100
二十六、备查文件.....	100
附件一：标的指数编制方案.....	102

## 一、绪言

《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“信息披露办法”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《上证 50 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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指上证 50 交易型开放式指数证券投资基金。
基金合同、《基金合同》：	指《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及基金合同当事人对其不时作出的修订。
招募说明书：	指本《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新。
基金产品资料概要：	指《上证 50 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。
托管协议：	指《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及基

	金管理人、基金托管人对其不时作出的修订。
发售公告：	指《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》。
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会。
中国银保监会：	指中国银行保险监督管理委员会。
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》及不时作出的修订。
《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。
《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。
《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。
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订。
《流动性风险管理规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；
交易型开放式指数证券投资基金：	指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”。
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基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。
基金管理人：	指华夏基金管理有限公司。
基金托管人：	指中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）。
合格境外投资者：	指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。
登记结算机构：	指中国证券登记结算有限责任公司。
登记结算业务：	指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登

	记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务。
募集期：	指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月的期间。
发售代理机构：	指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。
发售协调人：	指基金管理人指定的协调本基金发售等工作的代理机构。
申购赎回代理券商：	指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。
销售代理机构：	指发售代理机构和申购赎回代理券商。
基金合同生效日：	指基金合同满足生效条件后，基金管理人依法向中国证监会办理备案手续，自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。
申购：	指在基金合同生效后，投资者申请购买本基金基金份额的行为。
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为。
申购、赎回清单：	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。
申购对价：	指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
赎回对价：	指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
组合证券：	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。
标的指数：	指上证 50 指数及其未来可能发生的变更。
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，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。
现金差额：	指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差。投资者申购、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。

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。
基金份额参考净值：	指上海证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV。
预估现金部分：	指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额。
指定交易：	指《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的“指定交易”。
基金份额折算：	指本基金建仓结束后，基金管理人根据基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为。
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。
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累计报酬率差额之日，本基金收益评价日为每年 4 月 30 日和 10 月 31 日。
基金累计报酬率：	指收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去 100%。
标的指数同期累计报酬率：	指收益评价日标的指数收盘值与基金份额折算日标的指数收盘值之比减去 100%。
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息等的价值总和。
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值。
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的过程。
基金份额净值：	指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。
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、转融通证券出借业务中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券等。
转融通证券出借业务：	指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。
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报刊、互联网网站及其他媒介。
存续期：	指基金合同生效并存续的期限，本基金为不定期。
工作日：	指上海证券交易所的正常交易日。
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。
日/月：	指公历日/月。
T 日：	指本基金在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期。
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日。
元：	指人民币元。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲 3 号院

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：张佑君

联系人：邱曦

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	27.8%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
合计	100%

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

张佑君先生：董事长、党委书记，硕士。现任中信证券股份有限公司党委书记、执行董事、董事长；兼任中信集团、中信股份及中信有限总经理助理，中信金控副董事长。曾任中信证券交易部总经理、襄理、副总经理，中信证券董事，长盛基金管理有限公司总经理，中信证券总经理，中信建投总经理、董事长，中信集团董事会办公室主任，中证国际有限公司董事，中信证券国际、中信里昂（即 CLSA B.V. 及其子公司）董事长，中信里昂证券、赛领资本管理有限公司董事，金石投资董事长，中信证券投资董事长等。

J Luke Gregoire Gould先生：董事，学士。现任迈凯希金融公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾任IGM Financial Inc. 的执行副总裁兼首席财务官、Mackenzie Investments的首席财务官、Investors Group的高级副总裁兼首席财务官等。

李星先生：董事，硕士。现任春华资本集团执行董事，负责春华在金融服务行业的投资。曾任职于高盛集团北京投资银行部、春华资本集团分析师、投资经理等。

史本良先生：董事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司党委委员、执行委员、财富管理委员会主任、财富管理党委书记。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、总监、联席负责人、行政负责人、公司副财务总监、公司财务总监等。

薛继锐先生：董事，博士。现任中信证券股份有限公司执行委员。曾任中信证券股份有限公司金融产品开发小组经理、研究部研究员、交易与衍生产品业务线产品开发组负责人、股权衍生品业务线行政负责人、证券金融业务线行政负责人、权益投资部行政负责人等。

李一梅女士：董事、总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委副书记。兼任华夏基金（香港）有限公司董事长，华夏股权投资基金管理（北京）有限公司执行董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理、数据中心行政负责人（兼），上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理，华夏股权投资基金管理（北京）有限公司总经理（兼）、证通股份有限公司董事等。

刘霞辉先生：独立董事，硕士。现任中国社会科学院经济研究所国务院特殊津贴专家，

二级研究员，博士生导师。兼任中国战略研究会经济战略专业委员会主任、山东大学经济社会研究院特聘兼职教授及广西南宁政府咨询专家。曾任职于国家人社部政策法规司综合处。

殷少平先生：独立董事，博士。现任中国人民大学法学院副教授、硕士生导师。曾任最高人民法院民事审判第三庭审判员、高级法官，湖南省株洲市中级人民法院副院长、审判委员会委员，北京同仁堂股份有限公司、河北太行水泥股份有限公司独立董事，广西壮族自治区南宁市西乡塘区政府副区长，北京市地石律师事务所兼职律师等。

伊志宏女士：独立董事，博士。教授，博士生导师，主要研究方向为财务管理、资本市场、消费经济，曾任中国人民大学副校长，中国人民大学商学院院长，中国人民大学法学院院长，享受国务院政府特殊津贴。兼任国务院学位委员会第七届工商管理学科评议组召集人、国务院学位委员会第八届工商管理学科评议组成员、第五届全国MBA教育指导委员会副主任委员、教育部工商管理专业教学指导委员会副主任委员、中国金融会计学会副会长、欧洲管理发展基金会（EFMD）理事会理事、国际高等商学院协会（AACSB）首次认证委员会委员。

侯薇薇女士：监事长，学士。现任鲍尔太平有限公司（Power Pacific Corporation Ltd）总裁兼首席执行官，兼任加拿大鲍尔集团旗下Power Pacific Investment Management董事、投资管理委员会成员，加中贸易理事会国际董事会成员。曾任嘉实国际资产管理公司(HGI)的全球管理委员会成员、首席业务发展官和中国战略负责人等。

西志颖女士：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部行政负责人。曾任中信证券股份有限公司计划财务部统计主管、总账核算跨级主管、B角、B角（主持工作）等。

唐士超先生：监事，博士。现任中信证券股份有限公司风险管理部B角。曾在中信证券股份有限公司风险管理部从事风险分析、风险计量、市场风险和流动性风险管理等工作。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室执行总经理、行政负责人，董事会秘书。兼任证通股份有限公司董事。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人，客户运营服务部行政负责人（兼）。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

郑煜女士：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委副书记、基金经理等。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理，原中信基金股权投资部总监，华夏基金管理有限公司总经理助理、纪委书记等。

孙彬先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、投资经理等。曾任华夏基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理、公司总经理助理等。

张德根先生：副总经理，北京分公司总经理（兼）、广州分公司总经理（兼），硕士。曾任职于北京新财经杂志社、长城证券，曾任华夏基金管理有限公司深圳分公司总经理助理、副总经理、总经理，广州分公司总经理，上海华夏财富投资管理有限公司副总经理，华夏基金管理有限公司总经理助理、研究发展部行政负责人（兼）等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、纪委书记、法律部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人，合规部行政负责人等。

孙立强先生：财务负责人，硕士。现任华夏基金管理有限公司财务部行政负责人、华夏资本管理有限公司监事、上海华夏财富投资管理有限公司监事、华夏基金（香港）有限公司董事。曾任职于深圳航空有限责任公司计划财务部，曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角、财务部B角等。

桂勇先生：首席信息官，学士。兼任华夏基金管理有限公司金融科技部行政负责人。曾任职于深圳市长城光纤网络有限公司、深圳市中大投资管理有限公司，曾任中信基金管理有限责任公司信息技术部负责人，华夏基金管理有限公司信息技术部总经理助理、副总经理、行政负责人等。

## 2、本基金基金经理

徐猛先生，硕士。曾任财富证券助理研究员，原中关村证券研究员等。2006年2月加入

华夏基金管理有限公司，历任数量投资部基金经理助理，上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016年1月29日至2016年3月28日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年3月12日至2021年2月1日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年3月12日至2021年2月1日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年4月8日至2021年7月19日期间）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2017年12月8日至2021年7月19日期间）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年7月13日至2021年7月19日期间）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2018年8月14日至2021年7月19日期间）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019年6月5日至2021年7月19日期间）、华夏中小企业100交易型开放式指数基金发起式联接基金基金经理（2018年9月10日至2021年9月10日期间）等，现任投委会成员，恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年12月21日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年12月21日起任职）、中小企业100交易型开放式指数基金基金经理（2016年12月1日起任职）、华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016年12月1日起任职）、上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020年3月6日起任职）、华夏中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020年12月30日起任职）、华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（2021年1月26日起任职）、华夏恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（2021年2月1日起任职）、华夏中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年2月25日起任职）、华夏中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年4月7日起任职）、华夏恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（2021年5月18日起任职）、华夏中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年6月24日起任职）、华夏中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年7月13日起任职）、华夏中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年8月24日起任职）、华夏中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年8月31日起任职）、华夏恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理（2021年9月14日起任职）、华夏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）基金经理（2021年9月28日起任职）、华夏中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年10月26日起任职）、华夏中证沪港深500交易型开

放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2022年12月28日起任职）、华夏恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）基金经理（2023年7月18日起任职）。

历任基金经理：2004年12月30日至2017年3月24日期间，方军先生任基金经理；2016年11月18日至2024年11月25日期间，张弘弢先生任基金经理。

### 3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司总经理助理，基金经理、投资经理。

成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理，基金经理。

袁英杰先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理、投资经理。

荣膺女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

孙蒙先生，华夏基金管理有限公司数量投资部高级副总裁，基金经理。

### 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托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、勤勉尽责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、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定。

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之股

票、现金替代金额及现金差额。

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

12、编制季度、中期和年度报告。

13、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。

14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露。

15、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。

16、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。

17、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。

18、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。

19、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。

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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。

21、基金托管人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托管人追偿。

22、法律法规规定的其他义务。

#### （四）基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产。
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 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利益。
- （2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

#### 1、控制环境

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

（1）公司引入了独立董事制度，目前有独立董事3名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

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

（3）公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，并进行持续教育。



## 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

## 3、控制活动

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

### （1）投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建，基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

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

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

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

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

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

### （2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

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

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

### （3）技术系统控制制度

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

### （4）人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

### （5）监察制度

公司设立了监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

### （6）反洗钱制度

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

## 4、信息沟通

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

## 5、内部监控

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

## 6、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

#### 四、基金托管人

##### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

##### （二）主要人员情况

截至 2024 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 211 人，平均年龄 38 岁，99% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

##### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2024 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1428 只。自 2003 年以来，本行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 102 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国

内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制 COSO 准则从内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、监督与评价五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从 2005 年至今，中国工商银行资产托管部共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

##### 1、内部控制目标

- （1）资产托管业务经营管理合法合规；
- （2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；
- （3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；
- （4）提高资产托管经营效率和效果；
- （5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

##### 2、内部控制的原则

（1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。

（2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

（3）制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

（4）适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

（5）审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

（6）成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

### 3、内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

（1）总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

（2）总行内控合规部负责指导托管业务的内控管理工作，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中，将全行托管业务纳入内控评价体系。

（3）总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

（4）一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

### 4、内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在环境、制度、流程、岗位职责、人员、授权、创新、合同、印章、服务质量、收费、反洗钱、防止利益冲突、业务连续性、考核、信息系统等全方面执行内部控制措施。

### 5、风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管

理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理委员会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险和次生风险。

## 6、业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异地相结合的备份办公场所、必要的工作人员、科学清晰的 AB 岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异地异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

### （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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金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确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

（1）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：黄博铭

网址：www.gtja.com

客户服务电话：95521

（2）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区光华路10号

法定代表人：王常青

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

客户服务电话：95587、4008-888-108

（3）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦21楼

法定代表人：张纳沙

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：于智勇

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

（4）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.cmschina.com

客户服务电话：95565

（5）广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦36楼

法定代表人：林传辉

电话：020-66336146

传真：020-87555417

联系人：陈姗姗

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575

（6）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：郑慧

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（7）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：王晟

电话：010-80928123

传真：010-66568990

联系人：辛国政



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

客户服务电话：4008-888-888或95551

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路689号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号

法定代表人：周杰

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

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

客户服务电话：95553、400-888-8001

（9）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（200031）

法定代表人：杨玉成

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：余洁

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

客户服务电话：95523、400-889-5523

（10）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

传真：021-38565955

联系人：乔琳雪

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

客户服务电话：95562

（11）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务电话：95579、400-888-8999

（12）国投证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：段文务

电话：0755-81688000

传真：0755-81688090

联系人：陈剑虹

网址：<http://www.essence.com.cn/>

客户服务电话：95517

（13）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

电话：023-67663104

传真：023-63786212

联系人：魏馨怡

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

客户服务电话：95355

（14）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼

法定代表人：高振营

电话：021-50295432

传真：021-68865680

联系人：江恩前

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：95351

（15）国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

电话：0551-62257012

传真：0551-62272100

联系人：祝丽萍

网址：www.gyzq.com.cn

客户服务电话：95578

（16）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：安志勇

电话：022-23861683

传真：022-28451892

联系人：陈玉辉

网址：www.ewww.com.cn

客户服务电话：956066

（17）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

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

客户服务电话：95597

（18）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：肖海峰

电话：0532-85725062

传真：0532-85022605

联系人：赵如意

网址：[sd.citics.com/](http://sd.citics.com/)

客户服务电话：95548

（19）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

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

客户服务电话：95330

（20）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：肖林

电话：010-83252185

传真：010-63080978

联系人：付婷

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

客户服务电话：95321

（21）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32 层、36 层、39 层、40 层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326729

联系人：孔亚楠

网址：www.dfzq.com.cn

客户服务电话：95503

（22）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（23）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

法定代表人：曹宏

电话：0755-83530715

传真：0755-83515567

联系人：梁浩

网址：www.cgws.com

客户服务电话：95514、400-6666-888

（24）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：刘秋明

电话：021-22169999

联系人：郁疆

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（25）中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01号）1001室（部位：自编01号）

办公地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01号）1001室（部位：自编01号）

法定代表人：陈可可

电话：020-88834780

传真：020-88836914

联系人：郭杏燕

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：95548

（26）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：95360

（27）南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路389号

办公地址：江苏省南京市江东中路389号

法定代表人：李剑锋

电话：025-58519523

传真：025-83369725

联系人：王万君

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

客户服务电话：95386

（28）上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

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

客户服务电话：400-891-8918

（29）诚通证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路27号楼12层

办公地址：北京市朝阳区东三环北路27号楼12层

法定代表人：张威

电话：010-83561146

传真：010-83561164

联系人：田芳芳

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

客户服务电话：95399

（30）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

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

客户服务电话：95570

（31）浙商证券股份有限公司

住所：杭州市江干区五星路201号

办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

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

客户服务电话：95345

（32）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：何之江

电话：13916661875

传真：021-33830395

联系人：王阳

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

客户服务电话：95511-8

（33）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

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

客户服务电话：95563

（34）中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号



办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：鲁智礼

电话：0371-69099881、0371-69099882

传真：0371-65585899

联系人：程月艳、李盼盼

网址：www.ccnew.com

客户服务电话：95377

（35）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人：翁振杰

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（36）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（37）恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼；北京市西城区金融大街17号中国人寿中心11楼

法定代表人：祝艳辉

电话：021-68405273

传真：021-68405181

联系人：张同亮

网址：www.cnht.com.cn

客户服务电话：956088

（38）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-58124967

传真：028-86150040

联系人：谢国梅

网址：www.hx168.com.cn

客户服务电话：95584

（39）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

（830002）

法定代表人：王献军

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：梁丽

网址：www.swhysc.com

客户服务电话：95523、400-889-5523

（40）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：王洪

电话：021-20315719

传真：021-20315125

联系人：张峰源

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（41）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-23838750

传真：0755-25838701

联系人：单晶

网址：www.firstcapital.com.cn

客户服务电话：95358

（42）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网址：www.jyzq.cn

客户服务电话：95372

（43）德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：武晓春

电话：021-68761616

传真：021-68767032

联系人：刘熠

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

（44）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

电话：029-87211526

传真：029-87424426

联系人：梁承华

网址：www.westsecu.com

客户服务电话：95582

（45）中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：010-65051166

（46）财通证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87925129

传真：0571-87818329

联系人：夏吉慧

网址：www.ctsec.com

客户服务电话：95336

（47）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967656

传真：021-54967032

联系人：虞佳彦

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：95323、400-109-9918

（48）中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

联系人：胡芷境

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

（49）东方财富证券股份有限公司

住所：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号

法定代表人：戴彦

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：http://www.18.cn

客户服务电话：95357

（50）江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

联系人：姜志伟

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

客户服务电话：956007

（51）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

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

客户服务电话：95310

（52）华宝证券股份有限公司

住所：上海市陆家嘴环路166号27楼

办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

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

客户服务电话：400-820-9898

（53）华金证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层

法定代表人：宋卫东

电话：021-20655562

联系人：龙莹

网址：<https://www.huajinsc.cn/>

客户服务电话：956011

投资者应当通过基金管理人或其指定的集合申购代理机构的营业场所或按集合申购代理机构提供的其他方式办理基金的集合申购。基金管理人可依据实际情况增减、变更集合申购代理机构。

## 2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

## 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销售本基金。

### （二）登记结算机构

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

联系人：陈文祥

联系电话：021-68419095

传真：021-68870311

### （三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 A 座 509 单元

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 A 座 509 单元

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763999

传真：010-57763599

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

### （四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：单峰、朱宏宇

经办注册会计师：朱宏宇、朱寅婷

## 六、基金的募集

上证 50 交易型开放式指数证券投资基金由华夏基金管理有限公司依照《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 2004 年 11 月 22 日证监基金字[2004]196 号文批准募集。

本基金为交易型开放式基金，基金存续期限为不定期。

本基金募集期间每份基金份额面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

本基金自 2004 年 11 月 29 日至 2004 年 12 月 24 日进行发售。

本基金设立募集期共募集 5,435,331,306.00 份基金份额，有效认购户数为 37,267 户。

## 七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2004 年 12 月 30 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、基金份额折算与变更登记

根据基金合同和招募说明书的有关规定，本基金管理人确定 2005 年 2 月 4 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 50 指数收盘值为 872.884 点，基金资产净值为 5,616,630,897.30 元，折算前基金份额总额为 5,435,331,306 份，折算前基金份额净值为 1.033 元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 1.18384087，折算后基金份额总额为 6,434,566,757 份，折算后基金份额净值为 0.873 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司于 2005 年 2 月 16 日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位。

投资者可以自 2005 年 2 月 17 日起在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额。



## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金上市

根据有关规定，本基金合同生效后，具备上市条件，于 2005 年 2 月 23 日起在上海证券交易所上市交易。（交易代码：510050）

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定，包括但不限于：

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值。
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行。
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍，不足 100 份的部分可以卖出。
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元。
- 5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

### （三）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，上海证券交易所开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

#### 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = （申购、赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分） / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

- 2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。
- 3、上海证券交易所可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

## 十、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

本基金申购赎回代理机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“（一）基金份额销售机构”的相关描述。基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理机构，并在基金管理人网站公示。

## （二）申购与赎回的开放日及开放时间

### 1、开放日及开放时间

本基金在开放日为投资者办理申购、赎回等业务，开放时间为上午 9:30~11:30 和下午 1:00~3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

### 2、申购、赎回的开始时间

本基金已于 2005 年 2 月 23 日开放申购、赎回业务。

## （三）申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为 90 万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少 3 个工作日在中国证监会规定媒介公告。

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数额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

## （四）申购和赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前 3 个工作日在中国证监会规定媒介公告。

## （五）申购和赎回的程序

### 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股票和现金。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。

## 2、申购和赎回申请的确认与通知

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据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。投资者应在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询确认情况。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在 T+1 日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算。在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算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，并最迟于开始实施前 3 个工作日在中国证监会规定媒介公告。

## （六）申购、赎回的对价、费用及价格

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、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，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。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。

2、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 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。T 日的申购、赎回清单在当日上海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。

## （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、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金部分、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

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

（1）现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

#### （2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 + 现金替代溢价比例)

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的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现金替代溢价比例，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。

#### ③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；

若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股以及由于股权分置改革等发生的其他重要权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例（\%）} = \frac{\sum_i \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}} \times 100\%$$

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。参考基金份额净值目前为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### （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。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其 T 日预计开盘价。

## 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请

申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

T 日预估现金部分 = T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - （申购、赎回清单中必须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 日预计开盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日预计开盘价相乘之和）

其中，T 日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

## 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额 = T 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - （申购、赎回清单中必须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 日收盘价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和）

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

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

## 6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	20**-**-*
基金名称	上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华夏基金管理有限公司
一级市场基金代码	510050

T-1 日信息内容

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

T 日信息内容

预估现金部分（单位：元）	X
现金替代比例上限	X%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	X
申购、赎回的允许情况	允许申购和赎回

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	替代金额
X	X	X	X	X	X

以上申购赎回清单仅为示例，具体以实际公布的为准。

（八）暂停申购、赎回的情形

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购、赎回。
- 2、上海证券交易所/期货交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、上海证券交易所/期货交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购、赎回。
- 4、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。
- 5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回对价。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日报中国证监会备案，并及时公告。在暂停

申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

## （九）基金份额的集合申购

### 1、集合申购的定义

集合申购指投资者在本基金存续期内，在不对原有基金份额持有人利益造成影响的情况下，以符合条件的单只或多只标的指数成份证券为对价，在规定时间内申购本基金份额的行为。

基金管理人有权以集合申购清单或集合申购公告等形式设定成份证券的具体条件。

### 2、集合申购的场所

投资者应当通过基金管理人或其指定的集合申购代理机构的营业场所或按集合申购代理机构提供的其他方式办理基金的集合申购。

具体的集合申购销售机构将由基金管理人在基金管理人网站或相关公告列示。基金管理人可依据实际情况增减、变更集合申购销售机构。

### 3、集合申购的开放日及时间

投资者可在本基金规定的集合申购开放日办理基金份额的集合申购，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所集合申购开放日的正常交易时间，但法律法规、中国证监会另有要求或基金合同另有规定暂停集合申购的除外。

基金管理人应在开通集合申购业务前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上进行公告。开通集合申购业务后，集合申购开放日详见届时公布的集合申购清单。

### 4、集合申购的原则

（1）基金集合申购采用“份额申购”原则，即集合申购以份额申请。

（2）基金的集合申购对价包括证券及其他对价。

（3）办理集合申购的投资者应当提前与基金管理人签订服务协议，集合申购申请提交后不得撤销。

（4）集合申购应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及交易所、登记机构的相关规定。

（5）基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整，并在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 5、集合申购的程序



### （1）集合申购的申请方式

投资者必须根据基金管理人或集合申购代理机构规定的程序，在集合申购开放日的具体业务办理时间内提出集合申购的申请。

投资者集合申购基金份额时，必须根据相应的集合申购清单备足申购对价。投资者应保证提交的成份证券不存在处于司法冻结、质押、限售期、大宗交易或者协议转让的受让锁定期等导致无法卖出的情形，并及时履行因集合申购导致的股份减持所涉相关义务。

### （2）集合申购申请的确认

投资者集合申购申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的集合申购对价，则集合申购申请失败。

基金管理人或者集合申购代理机构对集合申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表确实接收到该申请。集合申购的确认以登记机构的确认结果为准。对于集合申购申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

如上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司对上述规则进行调整，本基金即适用其最新规则。基金管理人应在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （3）集合申购的清算交收与登记

本基金集合申购过程中涉及的基金份额及其对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。

投资人T日集合申购成功后，登记机构在T日收市后办理集合申购证券和基金份额的交收登记，并将结果发送给集合申购代理机构、基金管理人和基金托管人。

登记结算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、处理规则等进行调整，基金管理人应最迟于新规则开始实施前在指定媒介公告。

## 6、集合申购的数额限制

（1）投资人集合申购的基金份额需为最小申购单位的整数倍。最小申购单位由基金管理人确定和调整。目前，本基金最小申购单位为90万份。

（2）基金管理人可设定集合申购份额上限，以对当日的集合申购总规模进行控制，并通过集合申购清单等方式公告。

## 7、集合申购的对价和费用

（1）集合申购对价是指投资者集合申购基金份额时应交付的证券及其他对价。集合申

购对价根据集合申购清单和投资者集合申购的基金份额数额确定。

（2）T日的集合申购清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对集合申购清单格式和公告时间进行调整并公告。

（3）投资者在集合申购基金份额时，集合申购代理机构可按照不超过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。直销机构可参照上述标准收取申购费。

## 8、集合申购清单的内容与格式

### （1）集合申购清单的内容

T日集合申购清单公告内容包括最小申购单位所对应的每只可接受的成份证券数据、现金替代标志、溢价比率、可接受数量上限、基金份额净值、集合申购份额上限及其他相关内容。

### （2）证券对价相关内容

集合申购清单将公告可接受用于集合申购的每一只成份证券的证券代码、证券简称以及该只成份证券满足最小申购单位及其溢价比率所需要的证券数量。

集合申购清单成份股信息的每一行对应着投资者进行一个最小申购单位的集合申购所提供的证券对价信息。

### （3）溢价比率

溢价比率是指投资者在集合申购过程中，除按照集合申购清单中最小申购单位备足等价的成份证券之外，还需根据一定的比例额外交付相应数量的成份证券。根据溢价比率计算的需额外交付的成份证券数量已包含在集合申购清单的证券数量中。

收取溢价的原因是，投资者提交集合申购申请后，基金管理人对集合申购证券进行组合调整的实际价格（包含证券买卖价格及交易费用等）可能与该投资者集合申购时的参考价格有所差异。为便于操作，基金管理人在集合申购清单中预先确定溢价比率，并据此收取集合申购的证券。基金管理人将按照招募说明书约定的集合申购证券处理程序，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

### （4）集合申购证券的处理程序

T日，基金管理人在集合申购清单中公布可接受用于集合申购的证券数据和溢价比率，并据此收取集合申购证券。基金管理人自T+1日起按照法律法规、中国证监会及上海证券交易所的规定对收到的证券进行组合调整，组合调整过程中投资者用于集合申购的证券的价格

下跌和待买入的其他证券的价格上涨所造成的损失均由申请集合申购的投资者自身承担，计入集合申购退补款，不计入基金资产净值，不会对原有基金份额持有人利益造成影响。

基金管理人在T+10日内根据预先收取的证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用，下同）和其他证券的实际买入成本（买入价格加交易费用，下同）完成集合申购退补款的清算和交收，如果预先收取的证券（含证券溢价）实际卖出收入高于其他证券的实际买入成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的证券（含证券溢价）实际卖出收入低于其他证券的实际买入成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

T+9日前，若已购入全部被替代的证券，则以用于集合申购的证券的实际卖出收入与被替代证券的实际买入成本，确定基金应退还每个投资者或每个投资者应补交的款项；若T+9日日终仍未能购入全部被替代的证券，则以用于集合申购的证券的实际卖出收入与已买入的部分证券的实际买入成本加上按照T+9日收盘价计算的未买入的部分证券价值的差额，确定基金应退还每个投资者或每个投资者应补交的款项。

对于集合申购的基金份额，投资者在其对应的集合申购退补款交收完成前不得卖出或赎回。若因投资者用于集合申购的证券停牌等原因，导致基金管理人无法在规定时间内完成投资组合调整，则基金管理人有权代投资者提交基金份额赎回申请，并退回相应成份证券。

若基金管理人进行组合调整期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

#### （5）单只证券可接受数量上限

根据单只证券的流动性以及对现有组合的投资运作影响等情况，基金管理人可规定用以进行集合申购的单只证券数量上限，如果投资者的集合申购申请接受后将使当日单只证券的集合申购数量超过该证券的集合申购数量上限，基金管理人可根据集合申购清单全部或部分拒绝该证券的集合申购申请。

#### （6）集合申购清单的格式

集合申购清单仅用于投资者在办理基金集合申购时参考，不作为计算IOPV的依据。

集合申购清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	20**-**-**
基金名称	上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华夏基金管理有限公司

一级市场基金代码	510050
----------	--------

20\*\*-\*\*-\*\*（T-1 日）信息内容

最小申购单位净值（单位：元）	3,507,980.54
基金份额净值（单位：元）	3.898

20\*\*-\*\*-\*\*（T 日）信息内容

集合申购上限	无
最小申购单位(单位:份)	900,000
集合申购的允许情况	允许集合申购

20\*\*-\*\*-\*\*（T 日）成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量 （股）	现金替代 标志	溢价比率	可接受数量上限 （股）
600016	民生银行	743600	禁止	-	92,325,300
601398	工商银行	768700	禁止	-	368,311,900
600000	浦发银行	394600	禁止	-	61,386,400
600009	上海机场	52400	禁止	-	20,604,900
600028	中国石化	929900	禁止	-	188,870,100
600030	中信证券	120500	禁止	-	243,220,200
600036	招商银行	77700	禁止	-	113,386,600
600048	保利地产	254400	禁止	-	98,067,200
600050	中国联通	867200	禁止	-	253,380,000
600104	上汽集团	147600	禁止	-	113,234,800
600196	复星医药	75700	禁止	-	42,532,200
600276	恒瑞医药	33900	禁止	-	29,328,300
600519	贵州茅台	1800	禁止	-	4,515,500
600547	山东黄金	164300	禁止	-	37,468,000
600570	恒生电子	38300	禁止	-	26,425,700
600585	海螺水泥	67800	禁止	-	69,382,100
600588	用友网络	85600	禁止	-	27,206,500
600745	闻泰科技	34300	禁止	-	24,800,800
600837	海通证券	288200	禁止	-	104,136,200
600918	中泰证券	226200	禁止	-	56,629,200
601066	中信建投	85600	禁止	-	65,178,800
601088	中国神华	211800	禁止	-	51,490,100
601138	工业富联	264900	禁止	-	52,157,400
601166	兴业银行	185100	禁止	-	141,221,400
601186	中国铁建	484200	禁止	-	88,884,400
601211	国泰君安	214000	禁止	-	55,716,800
601236	红塔证券	213100	禁止	-	25,900,000
601288	农业银行	1225100	禁止	-	240,486,600

601318	中国平安	44000	禁止	-	111,639,500
601319	中国人保	598300	禁止	-	75,250,400
601336	新华保险	68200	禁止	-	19,418,700
601601	中国太保	95900	禁止	-	54,095,100
601628	中国人寿	94600	禁止	-	34,704,200
601668	中国建筑	781200	禁止	-	305,089,200
601688	华泰证券	197500	禁止	-	129,956,800
601816	京沪高铁	708100	禁止	-	57,344,900
601818	光大银行	969600	禁止	-	165,221,700
601857	中国石油	895400	禁止	-	131,871,400
603160	汇顶科技	24900	禁止	-	4,790,400
603288	海天味业	18300	禁止	-	6,515,700
603986	兆易创新	18800	禁止	-	12,234,900

说明：此表仅为示例，以实际公布为准。

#### 9、拒绝或暂停集合申购的情形和处理方式

（1）本基金当日集合申购总份额达到基金管理人所设定的上限，基金管理人可拒绝集合申购申请。

（2）本基金用于集合申购的证券达到该证券集合申购数量上限时，基金管理人可拒绝使用该证券集合申购的申请。

（3）本基金在集合申购期间，当用于集合申购的证券出现流动性严重不足、上市公司面临重大不确定性以及其他基金管理人认为可能对基金投资运作产生潜在不利影响的情形，基金管理人可全部或部分拒绝该证券的集合申购申请。

（4）集合申购申请不符合本招募说明书或合同、相关公告、投资者承诺、交易所相关规定及其他减持相关规定的要求，基金管理人可拒绝该集合申购申请。

（5）基金合同和招募说明书规定的其他拒绝或暂停申购申请的情形。

10、除本部分另有约定外，集合申购投资者的赎回业务办理适用本招募说明书规定的赎回规则与流程。

11、集合申购业务在申购方式、申购对价收取、申购清单编制、退补款计算方法及账务处理和清算交收等方面与一般申购业务存在差异，投资人应当按照本招募说明书的规定进行基金份额的集合申购。

12、投资者参与集合申购，应当遵守证券减持的相关规定和要求，并及时履行因集合申购导致的份额减持所涉信息披露等义务。

集合申购业务的未明确事宜，应遵循法律法规、交易所及登记机构的相关规定或业务规范以及基金管理人对本基金申购业务的相关规定。若市场情况发生变化，或相关业务规则发

生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对基金集合申购的业务规则等进行调整并公告，无须召开基金份额持有人大会。

#### （十）其他服务

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。

## 十一、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）投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

通常情况下，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，本基金在每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### （三）投资理念

中国经济和资本市场将长期快速增长，指数化投资可以以最低的成本和较低的风险获得市场平均水平的长期回报。标的指数具有良好的市场代表性、流动性与蓝筹特征，通过完全复制法实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，可以满足投资者多种投资需求。

#### （四）投资策略

##### 1、组合复制与替代性策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。

##### 1) 决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

##### 2) 投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：基金经理小组、研究人员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理小组根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理小组以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理小组将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理小组可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理小组将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

## 2、债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。基金还可参与风险低且可控的债券回购等投资。

## 3、衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权。

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

基金参与股票期权交易，应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。

## 5、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。

利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。

为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。



未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。

## （五）投资组合管理

### 1、投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为3步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金经理小组根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金经理小组在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%。本基金将在基金合同生效之日起3个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在合理期限内进行调整。

### 2、每日投资组合管理

（1）成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理小组分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

（5）组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

（6）以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，考虑T日将会发生的上市公司变动等情况，设计T日申购、赎回清单并公告。

### 3、定期投资组合管理

#### （1）每月

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

每月末，在基金经理小组会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

每月末，公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理小组根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

#### （2）每半年（标的指数调整周期）

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理小组依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

### 4、投资绩效评估

（1）每日，基金经理小组分析基金的跟踪偏离度。

（2）每月末，风险管理部对本基金的运行情况进行量化评估。

（3）每月末，基金经理小组根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整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。

### （六）标的指数

#### 1、本基金的标的指数为上证 50 指数。

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

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

本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 2、上证 50 指数

指数编制方案请参见本招募说明书附件，投资者可通过以下路径查询指数信息：

<http://www.csindex.com.cn>

### （七）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证50指数。

### （八）风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证50指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

### （九）禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、向基金管理人、基金托管人出资；
- 5、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 6、法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

### （十）投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （4）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得

超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

（8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（9）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（10）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（11）基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（12）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

（14）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；

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

（16）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；

B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

（17）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（6）、（13）、（14）、（16）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述（16）规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

（十一）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对所投资公司的控股或者直接管理。

2、所有参与行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金财产的保值和增值。

（十二）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2024 年第 1 季度报告：

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	111,309,210,170.86	98.90
	其中：股票	111,309,210,170.86	98.90
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,096,914,022.17	0.97
8	其他资产	138,184,194.93	0.12
9	合计	112,544,308,387.96	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 90,137,421.00 元,占本基金期末资产净值的 0.08%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,339,514,625.19	10.97
C	制造业	48,952,702,172.44	43.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,210,295,919.54	4.63
E	建筑业	3,762,263,370.05	3.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,105,701,197.40	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,841,453,590.13	5.19
J	金融业	30,015,206,207.45	26.69
K	房地产业	1,097,626,348.72	0.98
L	租赁和商务服务业	1,396,977,324.04	1.24

M	科学研究和技术服务业	1,587,458,973.70	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	15,863.38	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	111,309,215,592.04	98.97

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	10,520,541	17,915,429,268.90	15.93
2	601318	中国平安	180,234,869	7,355,385,003.89	6.54
3	600036	招商银行	207,284,014	6,674,545,250.80	5.93
4	601899	紫金矿业	275,842,453	4,639,670,059.46	4.13
5	600900	长江电力	163,917,079	4,086,452,779.47	3.63
6	601166	兴业银行	243,538,823	3,843,042,626.94	3.42
7	600276	恒瑞医药	74,775,826	3,437,444,721.22	3.06
8	600030	中信证券	162,875,533	3,127,210,233.60	2.78
9	601398	工商银行	586,977,295	3,099,240,117.60	2.76
10	600887	伊利股份	106,615,127	2,974,562,043.30	2.64

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IH2406	上证 50 股指期货 IH2406 合约	1,586	1,142,300,640.00	-5,533,161.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					-5,533,161.00
股指期货投资本期收益(元)					65,464,120.71
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-33,557,142.78

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	138,124,918.87



2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	59,276.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,184,194.93

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	-3.29%	1.21%	-5.50%	1.25%	2.21%	-0.04%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	127.78%	1.33%	126.69%	1.39%	1.09%	-0.06%

月 31 日						
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	135.79%	2.20%	134.13%	2.28%	1.66%	-0.08%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-65.19%	2.92%	-67.23%	3.08%	2.04%	-0.16%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	83.60%	2.03%	84.40%	2.07%	-0.80%	-0.04%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	-21.78%	1.54%	-22.57%	1.56%	0.79%	-0.02%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-17.24%	1.27%	-18.19%	1.28%	0.95%	-0.01%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	17.00%	1.21%	14.84%	1.21%	2.16%	0.00%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	-12.34%	1.55%	-15.23%	1.57%	2.89%	-0.02%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	65.88%	1.38%	63.93%	1.42%	1.95%	-0.04%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	-4.99%	2.50%	-6.23%	2.53%	1.24%	-0.03%
2016 年 1 月 1	-3.25%	1.24%	-5.53%	1.27%	2.28%	-0.03%

日至 2016 年 12 月 31 日						
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	27.16%	0.70%	25.08%	0.70%	2.08%	0.00%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-18.32%	1.37%	-19.83%	1.37%	1.51%	0.00%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	35.72%	1.21%	33.58%	1.21%	2.14%	0.00%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	20.64%	1.38%	18.85%	1.39%	1.79%	-0.01%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	-9.13%	1.22%	-10.06%	1.22%	0.93%	0.00%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-17.68%	1.31%	-19.52%	1.31%	1.84%	0.00%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	-9.26%	0.88%	-11.73%	0.88%	2.47%	0.00%
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日	3.61%	0.93%	3.82%	0.93%	-0.21%	0.00%
自基金合同生效起至今（2024 年 3 月 31 日）	301.61%	1.59%	186.20%	1.63%	115.41%	-0.04%

### 十三、基金的财产

#### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

#### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金财产账户独立。

#### （四）基金财产的处分

1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本基金财产。

3、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，本基金财产不属于其清算财产。

4、非因本基金财产本身承担的债务，不得对本基金财产强制执行。

5、基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、除《基金法》等相关法律法规及基金合同另有规定，基金财产不得被处分。

### 十四、基金资产的估值

#### （一）估值日

基金合同生效后，每开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日对基金资产进行估值。

#### （二）估值对象

基金依法拥有的股票、债券等有价值证券及其他资产。

#### （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。

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

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

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

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

#### （四）估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。

（4）交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收

利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（5）交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

6、本基金投资期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

7、基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

9、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。

10、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共

同查明原因，双方协商解决。

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

#### （五）估值程序与基金净值的确认

基金的日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果报送基金托管人，基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后将复核结果返回给基金管理人；月末、半年和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金资产估值出现错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当计价错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

#### （七）暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因停市时。
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。
- 3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值。
- 4、中国证监会认定的其他情形。

#### （八）特殊情形的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9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/期货交易市场及登记结算机构发送的数据错误，或由于不可抗力，基金管理人和基金托管人已经采取必要、适当、合理的措施进行检查仍未能发现的错误造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括：

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息收入。
- 2、买卖证券价差收入。
- 3、存款利息收入。
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权。
- 2、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，方可进行收益分配。
- 3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配1次，最多分配2次，若自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配。每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。
- 4、本基金收益分配采取现金方式。
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）基金收益分配数额的确定原则

- 1、本基金收益评价日为每年4月30日和10月31日。
- 2、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金份额折算日标的指数收盘价之比减去100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益：（基金累计报酬率－标的指数同期累计报酬率）×收益评价日发售在外的基金份额总额×基金份额折算日基金份额净值。



3、基金收益分配数额由基金管理人根据上述计算的基金超过标的指数的收益结合实际情况确定。

4、每基金份额的应分配收益为上述确定的基金收益分配数额除以收益评价日发售在外的基金份额总额，保留小数点后3位，第4位舍去。

#### （五）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，基金管理人按法律法规的规定公告。基金收益分配方案须载明基金可分配收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金运作费用

#### 1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （1）基金管理人的管理费。
- （2）基金托管人的托管费。
- （3）基金上市费及年费。
- （4）证券/期货交易费用。
- （5）基金收益分配中发生的费用。
- （6）基金份额持有人大会费用。

（7）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

- （8）其他按照国家有关规定可以列入的费用。

#### 2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。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为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人。

## （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。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为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金托管人。

（3）本条第（一）款第1项中第（3）至第（8）项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

## 3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

## （二）基金销售费用

投资者在申购或赎回基金份额时，需按照本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中“（六）申购、赎回的对价、费用及价格”的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

$$\text{申购/赎回佣金} = \text{申购/赎回份额} \times \text{佣金比率}$$

本基金申购、赎回佣金由申购赎回代理券商在投资者申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

## （三）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

# 十七、基金的会计与审计

## （一）基金会计年度、记账本位币、会计核算制度

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应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，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。

## （二）基金审计

1、基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。

2、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所须在2日内公告。

3、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和基金托管人同意。

## 十八、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### （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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定媒介披露，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、恭维性或推荐性文字；
- 6.中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1.基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上。基金招募说明书的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以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。

### 2.基金产品资料概要

基金管理人根据《信息披露办法》的要求公告基金产品资料概要。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 3 个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站上和基金销售机构网站上或营业网点。基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金产品资料概要。

关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自中国证监会规定之日起开始执行。

### 3.基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在规定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### 4.基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并至少提前 3 个工作日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结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将在 3 个工作日内将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

### 5.基金净值信息

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。

#### 6. 基金份额申购、赎回清单公告

基金管理人将在每个开放日公告当日的申购、赎回清单。

7. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《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 2 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。

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基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 8. 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）基金终止上市交易、《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）基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- （8）基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （9）基金管理人的董事在最近12个月内变更超过50%，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30%；
- （10）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- （11）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；
- （12）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- （13）基金收益分配事项；
- （14）管理费、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；
- （15）基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%；
- （16）本基金开始办理申购、赎回；
- （17）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- （18）本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- （19）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其它事项。

## 9.澄清公告

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

## 10.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。

#### 11. 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。

#### 12. 投资股指期货的相关公告

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）等文件中披露的股指期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### 13. 投资期权的相关公告

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示期权交易对基金总体风险的影响等。

#### 14. 投资资产支持证券的相关公告

在中期报告、年度报告等定期报告中披露本基金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。

在季度报告中披露本基金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。

#### 15. 参与融资及转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与融资及转融通证券出借业务的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### 16. 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以及证券交易所的自律管理规则。

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

基金管理人、基金托管人应当在规定的报刊中选择披露信息的报刊，本基金只需选择一家报刊。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照《信息披露办法》等相关法律法规的规定和中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### （八）法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。

### 十九、风险揭示

#### （一）投资于本基金的主要风险

##### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

##### 2、标的指数波动的风险

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

##### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

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

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

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



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

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

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

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

#### 4、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数的服务，从而会对基金投资运作造成不利影响。此外，根据基金合同的约定，出现指数发布机构变更或停止指数发布等情形，基金可能变更标的指数等，从而可能面临标的指数变更等的风险。

#### 5、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，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 6、成份券停牌或违约的风险

本基金的标的指数成份券可能出现停牌或违约，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份券进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

#### 7、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

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

#### 8、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

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

## 9、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。

## 10、投资者申购失败的风险

本基金的申购、赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

## 11、投资者赎回失败的风险

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

## 12、集合申购业务的风险

### （1）投资者集合申购失败的风险

基金管理人有权根据基金合同或本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的集合申购申请，从而导致集合申购失败。

基金的集合申购清单中，对可用于集合申购的成份券范围和成份券数量进行了限定，因此，投资者在进行集合申购时，可能存在用于集合申购的证券或证券数量与集合申购清单不符，导致参与本基金该次集合申购的所有投资者集合申购失败的风险。

### （2）集合申购组合调整的风险

投资者提交集合申购申请后，基金管理人将按照本招募说明书的规定对收到的证券进行组合调整。组合调整过程中投资者用于集合申购的证券的价格下跌和待买入的其他证券的价格上涨所造成的损失均由申请集合申购的投资者自身承担，计入集合申购退补款，不计入基金资产净值，不会对原有基金份额持有人利益造成影响。

### （3）基金份额无法卖出或赎回的风险

对于集合申购的基金份额，投资者在其对应的集合申购退补款交收完成前不得卖出或赎回，可能使投资者因无法及时卖出或赎回基金份额而影响投资收益。

#### （4）基金管理人代为赎回基金份额的风险

退补款交收完成前因成份券停牌等原因导致基金管理人无法在规定时间内完成投资组合调整时，基金管理人有权代投资者提交基金份额赎回申请，投资者应自行承担该部分成份券价格波动造成的损失。

#### （5）投资者需要补缴款项的风险

在极端市场情况下，预先收取的证券（含证券溢价）变现价值，可能低于基金其他证券的买入成本或结算成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。投资者存在需要补缴款项的风险。

### 13、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

### 14、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

（3）证券交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

### 15、存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

### 16、衍生品投资风险

本基金可投资于股指期货、股票期权等金融衍生品，投资期货、期权等金融衍生品主要存在以下风险：

（1）市场风险：是指由于衍生品价格变动而给投资者带来的风险。

（2）流动性风险：是指由于衍生品合约无法及时变现所带来的风险。

（3）基差风险：是指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

（4）**保证金风险：**是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（5）**信用风险：**是指经纪公司违约而产生损失的风险。

（6）**操作风险：**是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

#### 17、资产支持证券投资风险

（1）**流动性风险：**即证券的流动性下降从而给证券持有人带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）的可能性。

（2）**证券提前赎回风险：**若某些交易赋予 SPV 在资产支持证券发行后一定期限内以一定价格向投资者收购部分或全部证券的权利，则在市场条件许可的情况下，SPV 有可能行使这一权利从而使投资者受到不利影响。

（3）**再投资风险：**指证券因某种原因被提前清偿，投资者不得不将证券提前偿付资金再做其他投资时面临的再投资收益率低于证券收益率导致投资者不能实现其参与证券化交易所预计的投资收益目标的可能性。

（4）**SPV 违约风险：**在以债务工具（债券、票据等）作为证券化交易载体，也即交易所发行的证券系债权凭证的情况下，SPV 系投资者的债务人，其可能发生违约从而给投资者造成损失。

#### 18、参与转融通证券出借业务风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：

##### （1）流动性风险

面临大额赎回时，可能因证券出借原因，无法及时收回出借证券、无法及时变现支付赎回对价的风险。

##### （2）信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

##### （3）市场风险

证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

#### 19、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

根据证券交易资金前端风险控制相关业务规则，中登公司和交易所对交易参与人的证券交易资金进行前端额度控制，由于执行、调整、暂停该控制，或该控制出现异常等，可能影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。

## 20、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

## 21、流动性风险

在市场或个券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、以合理成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“八、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

### （2）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股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。一般情况下本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障持有人利益的基础上，防范流动性风险。

### （3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

①暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“八、基金份额的申购与赎回”中的“（七）暂停申购、赎回的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形。在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝。

②延缓支付赎回对价

投资人具体请参见基金合同“八、基金份额的申购与赎回”中的“（七）暂停申购、赎回的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回对价的情形。在此情形下，投资人接收赎回对价的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

③暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“十八、基金资产的估值”中的“（七）暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时基金赎回申请可能被暂停接受或被延缓支付赎回对价。

④中国证监会认定的其他措施。

22、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

（二）声明

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

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

## 二十、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

修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过，自表决通过之日起生效。但如因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的。
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的。
- 3、法律法规规定和中国证监会规定的其它情况。

基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算小组

在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

（2）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。

### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金财产。
- （2）基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认。
- （3）对基金财产进行评估和变现。
- （4）将基金财产清算结果报告中国证监会。
- （5）公布基金财产清算公告。
- （6）对基金财产进行分配。

基金财产清算的期限为自基金合同终止情形发生之日起不超过1年。

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产清算剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、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。基金财产清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在5个工作日内公告。

### 6、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20年以上。

## 二十一、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

### “十一、基金合同的当事人及其权利与义务

#### （一）基金管理人

#### 2、基金管理人的权利

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）运用基金财产。
- （2）获得管理人报酬。
- （3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利。
- （4）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整基金业务规则。
- （5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会、中国银保监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益。
- （6）在基金托管人更换时，提名新任基金托管人。
- （7）选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查。
- （8）选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册。
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请。



（10）在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务等。

（11）依法召集基金份额持有人大会。

（12）法律法规规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托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、勤勉尽责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）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定。

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之股票、现金替代金额及现金差额。

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

（12）编制季度、中期和年度报告。

（13）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。

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露。

（15）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。

（16）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。

- （17）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。
- （18）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。
- （19）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。
- （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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。
- （21）基金托管人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托管人追偿。
- （22）法律法规规定的其它义务。

## （二）基金托管人

### 2、基金托管人的权利

- （1）获得基金托管费。
- （2）监督基金管理人对本基金的投资运作。
- （3）自本基金合同生效之日起，依法持有并保管基金资产。
- （4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人。
- （5）依法召集基金份额持有人大会。
- （6）法律法规规定的其它权利。

### 3、基金托管人的义务

- （1）安全保管基金财产。
- （2）设立专门的基金托管部，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）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产。
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证。
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （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应予保密，不得向他人泄露。
- （8）对基金财务会计报告、季度、中期和年度基金报告出具意见，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。

- （9）建立并保存基金份额持有人名册。
- （10）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。
- （11）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。
- （12）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。
- （13）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。
- （14）按照规定监督基金管理人的投资运作。
- （15）按规定制作相关账册并与基金管理人核对。
- （16）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。
- （17）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会。
- （18）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。
- （19）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿。
- （20）法律法规规定的其他义务。

### （三）基金份额持有人

基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益。
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产。
- （3）依法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。
- （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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼。

（9）法律法规规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

（1）遵守基金合同。

（2）交纳基金认购、申购款项及规定的费用。

（3）在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。

（4）不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动。

（5）法律法规规定的其他义务。

## 十二、基金份额持有人大会

### （一）召开事由

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

1、变更基金类别。

2、变更基金投资目标、范围或策略。

3、变更基金份额持有人大会程序。

4、提前终止基金合同。

5、转换基金运作方式。

6、调整基金管理人、基金托管人的报酬标准。

7、更换基金管理人、基金托管人。

8、提前终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外。

9、与其他基金合并。

10、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会。

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

12、中国证监会规定的其他情形。

以下情形不需召开基金份额持有人大会：

1、暂停办理基金申购、赎回业务。

2、因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改。

3、对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化。

4、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

5、按照法律法规或本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）召集人和召集方式

1、在正常情况下，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者不能召集时，由基金托管人召集。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。

3、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。

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。

5、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、通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前30日，在中国证监会规定媒介公告通知。

### 2、通知内容

基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式。
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式。

（3）确定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）代理投票授权委托书送达时间和地点。

（5）会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、委托的公证机构及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

召集人可选择以现场开会、通讯开会方式召开基金份额持有人大会或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。

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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

（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，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的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、通讯方式开会。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会议通知约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知约定的其他方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）大会召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示

性公告。

（2）大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

（3）大会召集人在公证机构的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见。

（4）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的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书面意见或授权他人代表出具书面意见。

（5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如变更基金类别，变更基金投资目标、范围或策略，变更基金份额持有人大会程序，提前终止基金合同，转换基金运作方式，调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，更换基金管理人、基金托管人，提前终止基金上市，与其他基金合并以及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不得对未经公告的事项进行表决。

### 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（六）款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。基金份额持有人大会由基金管理人召集的，大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金托管人召集的，大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的，大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行

选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额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。

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人至少提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后二个工作日内统计全部有效表决，在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机构监督下形成的决议有效。

## （六）决议形成的条件、表决方式、程序

### 1、决议形成的条件

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50%以上（含50%）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。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。

### 2、表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

### 3、表决程序

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。计票程序如下：

#### （1）现场开会

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，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两名基金份额持有人与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人担任监票人。

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。



如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

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）通讯方式开会

采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

计票方式为：由大会召集人授权的2名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

## （七）基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式

基金份额持有人大会表决通过的事项，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定的事项自表决通过之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在中国证监会规定媒介公告。

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决议。

## （八）关于本基金的联接基金所持本基金份额行使表决权的方式

本基金的联接基金可以按照联接基金的基金合同的约定参加本基金的基金份额持有人大会。

## （九）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的。
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的。
- 3、法律法规规定和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。

## 二十五、争议的处理

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，应通过友好协商解决。经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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。

本合同受中国法律管辖。

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所查阅。投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。”

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《上证50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

### “一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲 3 号院

法定代表人：张佑君

成立时间：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

注册资本：2.38 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：100 年

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

## （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：廖林

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 三、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金投资组合的监督和检查自基金合同生效之后三个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，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确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者

遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》及其他有关法规、基金合同和本协议的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金资产保管的原则

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。

基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效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。

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托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于基金申购、赎回过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

## （二）基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期内，基金管理人及发售代理机构，将网下发售的认购资金划入基金管理人在银行开设的基金募集专户；网上现金认购结束，登记结算机构应将网上认购的资金划入发售协调人在银行开设的基金募集专户；网下股票认购结束，登记结算机构应根据基金管理人提供的资料对募集的股票进行冻结。基金募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，基金募集的股票存放在以基金名义开立的证券账户下，基金托管人在收到资金和股票当日出具基金资产接收报告。

## （三）基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该账户是指基金托管人为履行基金合同项下托管义务而特别开设的基金托管账户，并在其下为所托管的不同基金资产分别设置二级账户，以确保基金资产的完整与独立。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行和中国证券监督管理委员会的其他规定。

## （四）基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司（下称“登

记结算机构”）开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

基金托管人以基金托管人的名义在登记结算机构开立基金证券交易资金账户，用于证券结算。

#### （五）投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的交收指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代、现金差额的结算。

#### （六）基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入登记结算机构的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

#### （七）与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时，应保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。

### 七、资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算和复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总份额后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果通知基金管理人，由基金管理人将基金净值予以公布。

### 十、基金有关文件和档案的保存

基金管理人可委托登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。

### 十六、争议的处理和适用法律

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商

解决。经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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。

本协议受中国法律管辖。

#### 十八、托管协议的修改和终止

1、本协议相关各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。修改后的新协议，报中国证监会备案后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金合同终止。
- （2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人。
- （3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人。
- （4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。”

### 二十三、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、申购赎回代理机构提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

#### （一）呼叫中心

##### 1、自动语音服务

提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新热点问题、基金份额净值等信息。

##### 2、人工电话服务

提供每周 7 天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为 8：30~21：00，周六至周日的人工电话服务时间为 8：30~17：00，法定节假日除外。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

#### （二）在线服务

投资者可通过本公司网站、APP、微信公众号、微官网等渠道获得在线服务。

##### 1、自助服务

在线客服提供每周 7 天、每天 24 小时的自助服务，投资者可通过在线客服查询最新热点问题、业务规则、基金份额净值等信息。

## 2、人工服务

周一至周五的在线客服人工服务时间为 8:30~21:00，周六至周日的在线客服人工服务时间为 8:30~17:00，法定节假日除外。

## 3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：www.ChinaAMC.com

电子信箱：service@ChinaAMC.com

## （三）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过申购赎回代理机构的服务电话对该申购赎回代理机构提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十四、其他应披露事项

（一）2024 年 11 月 27 日发布华夏基金管理有限公司关于调整上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告。

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准上证50交易型开放式指数证券投资基金募集的文件以及准予变更注册的批复。
- 2、《上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《证券登记及服务协议》及附加协议。
- 4、《上证50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 5、法律意见书。



6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8、中国证监会要求的其他文件。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二四年十一月二十八日

## 附件一：标的指数编制方案

（最新的指数编制方案可登录指数公司网站查询）

上证50指数以上证180指数样本为样本空间，挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的50只证券作为样本，综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体表现。

### 一、指数名称和代码

指数名称：上证50指数

指数简称：上证50

英文名称：SSE 50 Index

英文简称：SSE 50

指数代码：000016

### 二、指数基日和基点

该指数以2003年12月31日为基日，以1000点为基点。

### 三、样本选取方法

#### 1、样本空间

上证180指数样本

#### 2、选样方法

对样本空间内的证券按照过去一年的日均总市值、日均成交金额进行综合排名，选取排名前50位的证券组成样本。

### 四、指数计算

指数计算公式为：

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

其中，调整市值 =  $\sum$  (证券价格 × 调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。

### 五、指数样本和权重调整

#### 1、定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。每次调整的样本比例一般不超过10%，定期调整设置缓冲区，排名在40名之前

的新样本优先进入，排名在60名之前的老样本优先保留。

## 2、临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。对新发行证券的发行总市值（总市值=发行价×总股本）和沪市证券自该新发行证券上市公告日起过去一年的日均总市值进行比较，对于符合样本空间条件、且发行总市值排名在沪市市场前10位的新发行证券，启用快速进入指数规则，即在其上市第十个交易日结束后将其纳入指数，同时剔除原样本中过去一年日均总市值、成交金额综合排名最末的证券，科创板上市证券不适用该规则。