

富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资 基金招募说明书

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2022 年 3 月 9 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2022】481 号《关于准予富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》）。

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

本基金标的指数为中证 1000 指数，指数简称中证 1000。指数代码：000852。标的指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：<http://www.csindex.com.cn>。

投资本基金风险详见招募说明书“风险揭示”章节，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、套利风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、申购及赎回风险、退市风险、终止清盘风险、第三方机构服务的风险、投资特定品种的特有风险、税负增加风险等等。本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，如本基金投资存托凭证的，在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

本基金目前仅采取深圳证券交易所跨市场股票 ETF 场内申赎模式，即“深市股票实物申购、沪市股票现金替代”申赎模式；通常情况下，T 日竞价买入的基金份额，T 日可以赎回，T 日申购的基金份额 T 日可以竞价卖出，T+1 日可以赎

回。投资者投资本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户或基金账户。其中，深圳证券交易所基金账户只能进行二级市场交易，如投资者需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所 A 股账户。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金合同生效后，连续 50 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会；出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。因而，本基金存在着无法存续的风险。

因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新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。

目 录

重要提示.....	2
第一部分 前言.....	5
第二部分 释义.....	6
第三部分 基金管理人.....	12
第四部分 基金托管人.....	26
第五部分 相关服务机构.....	28
第六部分 基金的募集.....	30
第七部分 基金合同的生效.....	38
第八部分 基金份额的折算与变更登记.....	40
第九部分 基金份额的上市交易.....	41
第十部分 基金份额的申购与赎回.....	43
第十一部分 基金份额的登记.....	81
第十二部分 基金的投资.....	83
第十三部分 基金的财产.....	92
第十四部分 基金资产估值.....	93
第十五部分 基金的收益与分配.....	100
第十六部分 基金的费用与税收.....	101
第十七部分 基金的会计与审计.....	103
第十八部分 基金的信息披露.....	104
第十九部分 风险揭示.....	112
第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	125
第二十一部分 基金合同的内容摘要.....	128
第二十二部分 基金托管协议的内容摘要.....	146
第二十三部分 对基金份额持有人的服务.....	157
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	159
第二十五部分 备查文件.....	160

第一部分 前言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定，以及《富国中证 1000 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。

本招募说明书阐述了富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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、义务的基本法律文件。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。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。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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人：指富国基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《富国中证 1000 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《富国中证 1000 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《富国中证 1000 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《富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《富国中证 1000 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
- 9、上市交易公告书：指《富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实

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

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

16、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 18 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

17、交易型开放式证券投资基金：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”

18、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

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

24、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（及颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，经中国证监会批准，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

26、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

27、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、赎回等业务

28、销售机构：指直销机构和代销机构

29、直销机构：指富国基金管理有限公司

30、代销机构：指符合《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，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

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

32、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、在基金合同生效后办理本基金申购、赎回业务的证券公司

33、登记业务：指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管和结算等业务

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

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

36、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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》**：指基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则和规定（包括其不时修订）

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兑换为赎回对价的行为

50、**申购赎回清单**：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、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组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

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赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

53、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证 1000 指数及其未来可能发生的变更

54、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

55、最小申购赎回单位：指基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

56、现金替代：指申购或赎回过程中，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

57、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按 T 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；投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

58、预估现金差额：指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结

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

60、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为

61、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

62、元：指人民币元

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

64、收益评价日：指基金管理人计算本基金份额净值增长率与标的指数同期增长率差额之日

65、基金份额净值增长率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

66、标的指数同期增长率：指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

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

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

70、基金资产估值：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

71、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

72、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

73、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出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

74、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

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

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

成立日期：1999 年 4 月 13 日

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

电话：（021）20361818

联系人：赵瑛

注册资本：5.2 亿元人民币

股权结构（截止于 2022 年 6 月 30 日）：

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设三十三个部门、三个分公司和二个子分公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、固定收益交易部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、养老

金业务部、银行业务部、券商业务部、机构服务部、零售业务部、华东零售总部、北方零售总部、营销管理部、客户服务部、数字金融业务部、战略与产品部、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部(董事会办公室)、信息技术部、运营部、不动产基金管理部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理(香港)有限公司、富国资产管理(上海)有限公司。

权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责固定收益类公募产品和部分非固定收益类公募产品的投资管理；固定收益专户投资部：负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理；固定收益信用研究部：建立和完善债券信用评级体系，开展信用研究等，为公司固定收益类投资决策提供研究支持；固定收益策略研究部：开展固定收益投资策略研究，统一固定收益投资中台管理，为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制；固定收益交易部：在公司投委会、分管领导授权范围内，负责审核并执行各固定收益投资组合指令，实现对投资交易一线风险控制的前提下，高效、公平地完成投资指令，并结合执行情况完成交易反馈；多元资产投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理；量化投资部：负责公司有关量化投资管理业务；海外权益投资部：负责公司在中国境外(含香港)的权益投资管理；权益专户投资部：负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理；养老金投资部：负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老金、社保等)及类养老金专户等产品的投资管理；权益研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责除固定收益之外的各类投资交易和风险控制；机构业务部：负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金 FOF、海外客户等客群的销售与服务；养老金业务部：负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务；银行业务部：负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务；券商业务部：根据公司发展战略，以券商客户为核心，打造包括私募、上市公司等在内的券商业务生态圈，深耕券

商总部及分支机构，带动券商代销及相关业务的发展，不断增加券商保有规模，提升公司品牌影响力，为公司整体业务协同提供有效补充；机构服务部：负责协调三个机构销售部门对接公司资源，实现项目落地，提供专业支持和项目管理,对公司已有机构客户进行持续专业服务；零售业务部：管理华东零售总部、北方零售总部、广州分公司、成都分公司，负责公募基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理，为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持；客户服务部：拟定客户服务策略，制定客户服务规范，建设客户服务团队，提高客户满意度，收集客户信息，分析客户需求，支持公司决策；数字金融业务部：结合数字经济与互联网发展特征，拟定并落实公司互联网基金销售与服务策略和实施细则，有效推进公司数字金融业务发展；战略与产品部：负责开发、维护公募和非公募产品，协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略，建立数据搜集、分析平台，为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责，开展内部审计，管理信息披露、法律事务等；风险管理部：执行公司整体风险管理策略，牵头拟定公司风险管理制度与流程，组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对，负责公司旗下各投资组合合规监控等；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；不动产基金管理部：根据公司发展战略，开展公开募集基础设施证券投资基金业务等；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；综合管理部（董事会办公室）：负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司（内部）宣传、信息调研、行政后勤管理等工作；富国资产管理（香港）有限公司：证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；富国资产管理（上海）有限公司：经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

截止到 2022 年 6 月 30 日，公司有员工 675 人，其中 77%以上具有硕士及以上学位。

二、主要人员情况

1、董事会成员

裴长江先生，董事长，研究生学历。现任海通证券股份有限公司副总经理。历任上海万国证券公司研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理，申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理，华宝信托投资有限责任公司投资总监，华宝兴业基金管理有限公司董事兼总经理。

陈戈先生，董事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司总经理。历任国泰君安证券有限责任公司研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、基金经理、研究部总经理、总经理助理、副总经理，2005年4月至2014年4月任富国天益价值证券投资基金基金经理。

麦陈婉芬女士 (Constance Mak)，董事，文学及商学学士，加拿大特许会计师。现任蒙特利尔银行全球资产管理亚洲区总经理 (General Manager, Asia, BMO Global Asset Management)，中加贸易理事会董事和加拿大中文电视台顾问团的成员。历任 St. Margaret's College 教师，加拿大毕马威 (KPMG) 会计事务所的合伙人。

方荣义先生，董事，博士，高级会计师。现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委副书记、监事、监事会主席。历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任，厦门大学工商管理教育中心副教授，中国人民银行深圳市中心支行会计处副处长，中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构监管处处长，中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长、国有银行监管处处长，申银万国证券股份有限公司财务总监，申万宏源证券有限公司副总经理、执行委员会成员、财务总监、董事会秘书。

张信军先生，董事，研究生学历。现任海通证券股份有限公司财务总监、海通国际控股有限公司副总经理兼财务总监、海通国际证券非执行董事、海通银行非执行董事。历任海通证券有限公司计划财务部员工、计划财务部资产管理部副经理/经理、海通国际证券集团有限公司首席财务官、海通国际控股有限公司首席风险官。

吴惠明先生，董事，硕士。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理。历任上海申银证券公司浦西管理总部交易部员工，申银万国证券股份有限公司经纪管理总部员工、办公室秘书、固定收益总部财务经理、党委办公室主任

兼任党委组织部副部长、人力资源总部副总经理，申万宏源证券有限公司党建工作部/党委办公室主任。

张晓燕女士，董事，博士。现任蒙特利尔银行亚洲区和蒙特利尔银行（中国）有限公司首席风险官。历任美国加州理工学院化学系研究员，加拿大多伦多大学化学系助理教授，蒙特利尔银行企业操作风险部高级分析师、高级风险经理和部门总监，道明证券交易风险管理部副总裁兼总监，华侨银行全球风险管理部副总裁、市场风险管控及分析主管，新加坡交易所风险管理部高级副总裁和风险管理主管。

王平先生，董事，硕士，高级会计师。现任山东省国际信托股份有限公司首席财务官。历任山东鲁信实业集团公司计划财务部副经理、经理，山东鲁信投资集团股份有限公司、山东鲁信房地产投资开发有限公司财务部经理，鲁信创业投资集团股份有限公司财务总监，鲁信资本管理有限公司财务总监。

李彧先生，独立董事，研究生学历，高级经济师。现任上海紫江（集团）有限公司副董事长、执行副总裁，上海威尔泰工业自动化股份有限公司董事长，上海紫竹高新区（集团）有限公司副董事长。历任上海紫江（集团）有限公司研究室科长、总裁室经理、总裁特别助理、董事、副总裁，上海紫江企业集团股份有限公司董事长。

季文冠先生，独立董事，研究生学历。现已退休。历任上海仪器仪表研究所计划科副科长、办公室副主任、办公室主任、副所长，上海市浦东新区综合规划土地局办公室副主任、办公室主任、局长助理、副局长、党组副书记，上海市浦东新区政府办公室主任、外事办公室主任、区政府党组成员，上海市松江区区委常委、副区长，上海市金融服务办公室副主任、中共上海市金融工作委员会书记，上海市政协常委、上海市政协民族和宗教委员会主任，上海金融业联合会常务副理事长。

李启安先生，独立董事，本科学历。现已退休。历任加拿大花旗银行副总裁，加拿大皇家地产服务有限公司亚洲业务发展部总监，MKI 集团有限公司（香港上市公司）执行董事，获多利金融服务有限公司（香港汇丰银行子公司）中国部高级副总裁，香港万都房产发展有限公司高级副总裁，香港大昌行集团有限公司

(中信泰富集团子公司)集团财务总经理及曾派驻为上海总经理,香港汇丰银行私人银行部高级副总裁并派驻上海分行任财富管理总经理,万都项目管理有限公司财务总监。

刘江宁女士,独立董事,博士,副教授。现任对外经济贸易大学全球化与中国现代化问题研究所研究员。历任山东财经大学教师。

2、监事会成员

田志国先生,监事长,研究生学历。现任山东省国际信托股份有限公司首席风险官。历任山东省电子经济贸易中心综合部经理,山东省国际信托投资有限公司稽核法律部项目经理,山东省国际信托有限公司信托五部项目经理、信托业务五部副总经理,山东省国际信托股份有限公司信托业务五部总经理。

曹志刚先生,监事,经济学硕士。现任海通证券股份有限公司稽核部副总经理,海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司监事,海通创意资本管理有限公司监事。历任海通证券股份有限公司风险控制总部(稽核部)二级部经理、稽核部总经理助理。

孙兆军先生,监事,研究生学历。现任申万宏源证券有限公司资产管理事业部副总经理、合规负责人。历任上海市经济工作党委副书记科员,上海市经济和信息化工作党委副书记科员、主任科员,上海证监局主任科员,兴业银行上海分行金融市场部业务经理,申银万国证券股份有限公司资产管理事业部产品评审总部副总经理,申万宏源证券有限公司资产管理事业部业务管理总部、业务拓展总部总经理、合规与风险管理中心副主任兼风险管理总部副总经理、法律合规总部副总经理(主持工作)。

赵士毅先生,监事,本科学历。现任蒙特利尔银行(中国)有限公司董事总经理、亚洲企业投资发展部负责人。历任中国银联股份有限公司国际业务总部亚太业务发展业务主管,西班牙对外银行中国区执行董事、业务发展主管、中国区私人银行副总裁、中信-西班牙对外银行私人银行管理团队、亚洲零售银行助理副总裁、西班牙对外银行全球青年领导层培训生,上海复星高科技(集团)有限公司国际发展部执行总经理兼集团财富管理和私人银行委员会委员,蒙特利尔银行(中国)有限公司亚洲区战略发展总监。

夏志辉先生，监事，本科学历。现任富国基金管理有限公司集中交易部投研中台总监兼高级金融平台研究经理。历任北京江河幕墙工程有限公司 ERP 部门系统管理员，上海霸才软件有限公司系统信息部系统管理员，上海绘梦视信息技术有限公司技术部数据库管理员，富国基金管理有限公司信息部高级系统管理员，光大保德信基金管理有限公司信息部主管，富国基金管理有限公司高级风险管理经理、集中交易部风控总监助理、集中交易部风控副总监。

孙玉礼先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司权益投资部资深基金专员。历任美世咨询数据中心数据分析师，韬睿惠悦管理咨询(深圳)有限公司福利部精算顾问，上海泽奔商务咨询有限公司咨询顾问，富国基金管理有限公司高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理、基金专员。

程钺女士，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司机构服务部副总经理。历任富国基金管理有限公司机构客户经理、高级机构客户经理、高级项目经理、资深项目经理、机构服务部机构总监助理、机构服务部机构副总监兼资深项目经理。

黄奥博先生，监事，研究生学历。现任富国基金管理有限公司战略与产品部副总经理。历任国联安基金管理有限公司产品部产品经理助理，齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司产品部产品高级经理，富国基金管理有限公司产品经理、高级产品开发经理、资深产品开发经理、战略与产品部产品开发总监助理、战略与产品部产品副总监、战略与产品部产品总监。

3、督察长

赵瑛女士，研究生学历，硕士学位。曾任职于海通证券有限公司投资银行总部、国际业务部；上海国盛（集团）有限公司资产管理部、风险管理部；海通证券股份有限公司合规与风险管理总部；上海海通证券资产管理有限公司合规与风控部；2015 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任监察稽核部总经理，现任富国基金管理有限公司督察长。

4、经营管理层人员

陈戈先生，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

林志松先生，本科学历，工商管理硕士学位。曾任漳州进出口商品检验局秘书、晋江进出口商品检验局办事处负责人、厦门证券公司业务经理；1998 年 10 月参与富国基金管理有限公司筹备，历任监察稽核部稽察员、高级稽察员、部门副经理、部门经理、督察长，现任富国基金管理有限公司副总经理兼首席信息官。

陆文佳女士，研究生学历，硕士学位。曾任中国建设银行上海市分行职员，华安基金管理有限公司市场总监、副营销总裁；2014 年 5 月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金管理有限公司副总经理。

李笑薇女士，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家教委外资贷款办公室项目官员，摩根士丹利资本国际 Barra 公司（MSCI BARRA）BARRA 股票风险评估部高级研究员，巴克莱国际投资管理公司（Barclays Global Investors）大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任基金经理、量化与海外投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

朱少醒先生，研究生学历，博士学位。2000 年 6 月加入富国基金管理有限公司，历任产品开发主管、基金经理助理、基金经理、研究部总经理、权益投资部总经理、公司总经理助理，现任富国基金管理有限公司副总经理兼基金经理。

5、本基金基金经理

金泽宇，博士，自 2018 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、初级定量研究员；现任富国基金量化投资部定量研究员，拟任基金经理。具有基金从业资格。

6、投资决策委员会

公司投委会成员：总经理陈戈，分管副总经理朱少醒，分管副总经理李笑薇。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (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) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- (14) 其他法律、行政法规禁止的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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及基金合同规定禁止从事的其他活动。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行。

六、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、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的风险管理体系和内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

(1) 建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在的原因。

(3) 分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

(5) 处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低的风险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1) 内部控制的原则

①全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

②独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核职能部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

③相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

④重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

(2) 内部控制的主要内容

①控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立有独立董事参加的风险委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会、风险控制委员会等委员会，分别负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

②风险评估

公司内部稽核人员定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度，并将评估报告报总经理办公会和风险控制委员会。

③操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

④信息与沟通

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，保证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，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

⑤监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核职能部门，履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员具有相对的独立性，监察稽核报告提交全体董事审阅并报中国证监会。

3、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人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) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2022 年 3 月 31 日，中国银行已托管 1006 只证券投资基金，其中境内基金 958 只，QDII 基金 48 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管

规模位居同业前列。

二、基金托管人的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，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、网下现金发售的直销机构：

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

总经理：陈戈

直销网点：直销中心

直销中心地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 27 层

客户服务统一咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）

传真：021-20513177

联系人：孙迪

公司网站：www.fullgoal.com.cn

2、网下现金发售代理机构

具体名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加或调整本基金基金份额发售机构，并在基金管理人网站公示。

3、网上现金发售代理机构

投资者可直接通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。

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：（010）50938782

传真：（010）50938991

联系人：赵亦清

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：黎明、陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：王珊珊

经办注册会计师：王珊珊、费泽旭

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据

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募集,已于 2022 年 3 月 9 日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2022】481 号《关于准予富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》)。

二、基金类型、运作方式和存续期间

- 1、基金的类别: 股票型证券投资基金
- 2、基金运作方式: 契约型, 交易型开放式
- 3、基金存续期限: 不定期

三、募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员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。

网下股票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股票进行的认购。

投资者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。

基金管理人可以根据情况调整销售机构, 并在基金管理人网站公示。

基金投资者在募集期内可多次认购, 认购一经受理不得撤销。

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。如投资者怠于履行该项查询等各项义务，因此产生的损失由投资者自行承担。

四、募集期限

募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。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（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时公告。

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、机构投资者和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。

六、募集场所

投资人可在基金管理人及其指定的发售代理机构办理基金认购业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金认购业务的具体情况和联系方法，请参见基金份额发售公告。

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。

七、基金的最低募集份额总额和募集金额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币。

本基金可设置首次募集规模上限，超过募集规模上限时基金管理人可以采用比例确认或其他方式进行确认，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。

八、基金份额的发售面值和认购价格

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

九、认购费用

本基金认购费用由投资者承担，认购费率如下表所示：

认购份额 (M)	认购费率
M < 50 万份	0.80%
50 万份 ≤ M < 100 万份	0.50%
M ≥ 100 万份	1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

十、认购开户

1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 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“深圳证券交易所证券投资基金账户”）。

（1）已有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

（2）尚无深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳 A 股账户和深圳证券交易所证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

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）如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。

（3）如投资人以上海证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，

并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

(4) 已购买过由富国基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资者，其拥有的富国基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

十一、网上现金认购

1、认购时间详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1000 份或其整数倍。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

3、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。认购申请一经确认，不得撤销。

4、认购金额的计算

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

(或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(或若适用固定费用的，认购佣金 = 固定费用)

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资者所有，利息以登记机构的记录为准。利息折算份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足 1 份的部分归入基金资产。

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，投资者应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。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者单笔认购须为 1000 份或其整数倍。投资者可以多次认购，累计认购金额不设上限，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按基金管理人或发售代理机构的规定办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

4、认购金额的计算

通过基金管理人或发售代理机构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：

认购费用 = 认购价格 × 认购份额 × 认购费率

（或若适用固定费用的，认购佣金 = 固定费用）

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 认购费率)

（或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用）

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资者所有，利息以基金管理人的记录为准。利息折算份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足 1 份的部分归入基金资产。

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：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十三、网下股票认购

1、认购时间详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，投资者应以 A 股账户认购。用以认购的股票必须是基金的标的指数成份股及备选成份股（具体名单以基金份额发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：投资者在认购基金时，需按发售代理机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销，发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

4、认购费用（佣金）

认购费用（或佣金）由基金管理人、发售代理机构在投资者认购确认时收取，在发售代理机构允许的条件下，投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用（或佣金）。

投资者选择以现金方式支付认购费用（或佣金），则需支付的认购费用（或佣金）按以下公式计算：

$$\text{认购费用（或佣金）} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率（或佣金比率）}$$

投资者选择以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。以基金份额支付佣金，则认购佣金和可得到的基金份额按以下公式计算：

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

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金} / \text{基金份额初始面值}$$

5、特殊情形

（1）已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

（2）限制个股认购规模：基金管理人可对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。如果投资者的个股认购规模超过该券在标的指数的构成比例，基金管理人有权对超过构成比例的部分予以拒绝。

（3）临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常或长期停牌的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

（4）根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

6、清算交收：

网下股票认购期内每日日终,发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发给基金管理人。T 日日终 (T 日为本基金发售期最后一日), 发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人, 基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起, 登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结, 并将投资者深圳市场网下认购股票划转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的 ETF 证券认购专户。以基金份额方式支付认购费用/佣金的, 基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的认购费用/佣金, 并从投资者的认购份额中扣除, 为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据, 将上海和深圳的股票分别过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后, 登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

7、认购份额的计算公式:

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中,

(1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票, n 代表投资者提交的股票总只数。如投资者仅提交了 1 只股票的申请, 则 $n=1$ 。

(2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价” 由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据, 以该股票的总成交金额除以总成交股数计算, 以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交, 则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股 (转增)、配股等权益变动, 则由于投资者获得了相应的权益, 基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

除息: 调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

送股: 调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/ (1+每股送股比例)

配股: 调整后价格= (网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例) / (1+每股配股比例)

送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

（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股票股数。

对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。对于基金管理人未确认的认购股票，登记机构将不办理股票的过户业务，正常情况下，投资者未确认的认购股票将在认购截止日后的 4 个工作日起可用。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法冻结或执行，基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

8、特别提示：投资者应根据法律法规及深圳证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

十四、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。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归投资者所有。募集的股票由登记机构予以冻结，募集股票在冻结期间所产生的权益归属依据相关规则办理。

十五、发行联接基金或增设新的份额类别

在不违反法律法规、基金合同规定及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，与基金托管人协商一致，并履行适当程序后，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，或为本基金增设新的份额类别，而无需召开基金份额持有人大会审议。

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（含网下股票认购所募集的股票市值）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。网下股票认购所募集的股票由登记机构予以冻结。

二、基金合同不能生效时募集资金及股票的处理方式

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；对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记机构应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开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 基金份额折算与变更登记

基金合同生效后,为提高交易便利或基金运作需要,本基金可以进行份额折算。

一、基金份额折算的时间

基金管理人可根据实际需要确定基金份额折算日,并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

二、基金份额折算的原则

基金份额折算是指基金管理人根据基金运作的需要,在基金资产净值不变的前提下,按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值。基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理,并由登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后,本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响(因小数点后的尾数处理而产生的损益不视为实质性影响)。基金份额折算后,基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记机构遇特殊情况无法办理,基金管理人可延迟办理基金份额折算。

三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的上市交易

一、基金份额的上市

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、场内募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元；
- 2、场内基金份额持有人不少于 1,000 人；
- 3、法律法规及深圳证券交易所规定的其他条件。

基金份额获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金份额上市日前按相关法律法规要求发布基金份额上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易，应遵照《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。

若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所对基金上市交易的相关规定进行调整的，基金合同可相应修改，无需召开基金份额持有人大会。

三、基金在深圳证券交易所停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市的情形和处理方式

基金份额在深圳证券交易所上市后，如遇停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市的情形，按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定业务规则、通知、指引、指南等执行。

当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，本基金将按基金合同的约定变更为非上市的开放式指数基金，基金名称变更为“富国中证 1000 指数证券投资基金”，无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金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，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。具体情况见基金管理人届时公告。

四、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人或者基金管理人委托的机构可以在交易时间内，根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV），并由深圳证券交易所交易所在交易时间内发布，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成份证券的必须替代金额之和 + 申购赎回清单中可以用现金替代的成份证券的数量与最新成交价乘积之和 + 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差额) / 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、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

五、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，在履行适当程序后，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。

六、相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。

七、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。

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

投资人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。

基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

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

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，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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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。

三、申购与赎回的原则

1、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》和《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其他相关规定。

2、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。

3、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。

4、申购、赎回申请提交后不得撤销。

5、基金的申购、赎回对价依据招募说明书约定的代理买卖原则确定，与受理申请当日的基金份额净值或有不同。

6、在条件允许的情况下，基金管理人可以调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成。

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

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整，或依据深圳证券交易所、登记机构相关规则及其变更调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各申购赎回代理券商的具体规定为准。

2、申购与赎回申请的确认

投资者提交的申购、赎回申请将按照《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》和《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其他相关规定的有关规则进行确认。基金投资者符合要求的申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据申购赎回清单要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

申购赎回代理券商受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。如投资者怠于履行该项查询等各项义务，因此产生的损失由投资者自行承担。

投资者申购的基金份额 T 日可竞价卖出，T+1 日可赎回或者大宗卖出；投资者赎回获得的组合证券 T 日可竞价卖出，T+1 日可用于申购基金份额或大宗卖出。

3、申购与赎回的清算交收

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。

投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理深交所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收与现金差额的清算，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。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理深交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代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。

如果登记机构在清算交收时发生清算交收参与方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》等《业务规则》的有关规定进行处理。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。

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跨市场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、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本基金的基金合同和招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资者申购、赎回的基金份额须为最小申购赎回单位的整数倍，目前，本基金的最小申购赎回单位为 300 万份。基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求，在法律法规允许的情况下，调整最小申购赎回单位。

2、基金管理人可以根据基金组合情况等因素，设定单日申购份额上限和赎回份额上限，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，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、单日或单笔申购份额上限和净申购比例上限，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比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求等情形，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购份额和赎回份额的数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的对价、费用及其用途

1、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。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，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。

2、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。

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

未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，或实际情况需要，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对申购对价、赎回对价组成、基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间或频率进行调整并提前公告。

3、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组合证券、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。

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”）、必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，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。

可以现金替代适用于所有成份股。用于深圳证券交易所上市的成份股时是指

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。用于上海证券交易所上市的成份股时是指在申购或赎回基金份额时，必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

（2）可以现金替代

①适用情形：对于深市成份证券，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。对于沪市成份证券，登记机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。

②替代金额：

对于深市成份证券，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 + 申购现金替代保证金率)

对于沪市成份证券，可以现金替代的证券替代金额的计算公式为：

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

赎回替代金额 = 替代证券数量 × 该证券参考价格 × (1 - 赎回现金替代保证金率)

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

申购时收取申购现金替代保证金的原因是，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。

赎回时扣除赎回现金替代保证金的原因是，对于可以现金替代的沪市证券，

基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回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赎回现金替代保证金率，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

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申购现金替代保证金率和赎回现金替代保证金率，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。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 N+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。N+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 N+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。

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 N+2 日）内，基金管理人将卖出赎回被替代的沪市证券。T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以预先支付的金额和被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以预先支付的金额和被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，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 N+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个

交易日) 期间发生除息、送股(转增)、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动, 则进行相应调整。

N+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数据发送给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: 针对深市成份证券, 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:

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{基金份额参考净值}} \times 100\%$$

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, 如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化, 以深圳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, 如果深圳证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化, 以深圳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将被剔除, 或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额: 对于必须现金替代的证券, 基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金, 即“申购替代金额”和“赎回替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后 T 日开盘参考价。

4、预估现金差额相关内容

预估现金差额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。

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、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份

证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和+申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和)

其中,该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份股的调整后开盘参考价确定。另外,若 T 日为基金分红除息日,则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、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、赎回清单中必须现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以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

基金名称	富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	富国基金管理有限公司
基金代码	XXXXXX
目标指数代码	000852
基金类型	跨市场 ETF

T-1 日信息内容

现金差额 (单位: 元)	104,793.00 元
最小申购、赎回单位净值 (单位: 元)	3,000,000.00 元
基金份额净值 (单位: 元)	1 元

T 日信息内容

预估现金差额:	104,793.00 元
可以现金替代比例上限:	50%
是否需要公布 IOPV:	是
最小申购、赎回单位:	3,000,000 份
最小申购赎回单位现金红利:	0.00 元
本市场申购赎回组合证券只数:	576 只
全部申购赎回组合证券只数:	1001 只(含 159900 证券)
是否开放申购:	允许
是否开放赎回:	允许
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:	300000000 份
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

组合信息内容

证券代码	证券简称	股 份 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
000006	深振业 A	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000011	深物业 A	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000016	深康佳 A	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000019	深粮控股	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000025	特力 A	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000030	富奥股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000032	深桑达 A	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000034	神州数码	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000035	中国天楹	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000036	华联控股	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000048	京基智农	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000049	德赛电池	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000058	深赛格	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000059	华锦股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000061	农 产 品	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000065	北方国际	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000070	特发信息	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

000088	盐田港	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000090	天健集团	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000155	川能动力	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000403	派林生物	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000422	湖北宜化	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000423	东阿阿胶	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000426	兴业矿业	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000498	山东路桥	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000503	国新健康	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000507	珠海港	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000517	荣安地产	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000539	粤电力 A	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000543	皖能电力	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000546	金圆股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000550	江铃汽车	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000555	神州信息	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000557	西部创业	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000560	我爱我家	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000566	海南海药	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000567	海德股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000582	北部湾港	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000591	太阳能	1000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000592	平潭发展	900	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000597	东北制药	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000600	建投能源	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000601	韶能股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000603	盛达资源	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000612	焦作万方	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000615	奥园美谷	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000627	天茂集团	900	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000639	西王食品	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000650	仁和药业	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000652	泰达股份	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000657	中钨高新	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000672	上峰水泥	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000676	智度股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000681	视觉中国	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000682	东方电子	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000683	远兴能源	1200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000688	国城矿业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000697	炼石航空	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

000710	贝瑞基因	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000712	锦龙股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000727	冠捷科技	1300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000735	罗牛山	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000758	中色股份	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000761	本钢板材	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000762	西藏矿业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000767	晋控电力	900	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000789	万年青	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000791	甘肃电投	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000795	英洛华	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000801	四川九洲	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000810	创维数字	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000811	冰轮环境	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000813	德展健康	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000818	航锦科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000823	超声电子	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000828	东莞控股	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000829	天音控股	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000848	承德露露	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000851	高鸿股份	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000860	顺鑫农业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000875	吉电股份	900	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000881	中广核技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000885	城发环境	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000893	亚钾国际	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000901	航天科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000902	新洋丰	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000903	云内动力	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000910	大亚圣象	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000913	钱江摩托	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000915	华特达因	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000917	电广传媒	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000918	嘉凯城	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000921	海信家电	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000923	河钢资源	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000927	中国铁物	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000928	中钢国际	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000931	中关村	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000933	神火股份	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000935	四川双马	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

000936	华西股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000950	重药控股	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000951	中国重汽	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000958	电投产融	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000966	长源电力	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000968	蓝焰控股	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000969	安泰科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000976	华铁股份	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000982	中银绒业	2000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
000989	九芝堂	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
001213	中铁特货	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
001696	宗申动力	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002015	协鑫能科	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002017	东信和平	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002020	京新药业	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002023	海特高新	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002025	航天电器	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002034	旺能环境	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002035	华帝股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002036	联创电子	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002038	双鹭药业	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002041	登海种业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002042	华孚时尚	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002043	兔宝宝	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002044	美年健康	1300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002055	得润电子	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002061	浙江交科	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002063	远光软件	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002079	苏州固锝	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002085	万丰奥威	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002091	江苏国泰	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002097	山河智能	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002099	海翔药业	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002100	天康生物	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002106	莱宝高科	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002108	沧州明珠	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002123	梦网科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002126	银轮股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002130	沃尔核材	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002135	东南网架	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002139	拓邦股份	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

002145	中核钛白	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002151	北斗星通	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002158	汉钟精机	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002163	海南发展	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002171	楚江新材	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002176	江特电机	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002182	云海金属	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002190	成飞集成	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002192	融捷股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002194	武汉凡谷	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002201	正威新材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002204	大连重工	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002206	海利得	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002214	大立科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002215	诺普信	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002216	三全食品	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002217	合力泰	1000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002218	拓日新能	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002222	福晶科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002226	江南化工	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002232	启明信息	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002234	民和股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002237	恒邦股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002239	奥特佳	1000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002243	力合科创	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002245	蔚蓝锂芯	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002251	步步高	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002254	泰和新材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002258	利尔化学	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002261	拓维信息	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002262	恩华药业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002267	陕天然气	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002274	华昌化工	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002276	万马股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002283	天润工业	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002285	世联行	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002287	奇正藏药	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002291	星期六	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002292	奥飞娱乐	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002293	罗莱生活	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002298	中电兴发	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

002301	齐心集团	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002303	美盈森	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002307	北新路桥	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002310	东方园林	1000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002312	川发龙蟒	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002314	南山控股	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002318	久立特材	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002320	海峡股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002324	普利特	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002332	仙琚制药	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002335	科华数据	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002344	海宁皮城	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002351	漫步者	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002367	康力电梯	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002376	新北洋	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002378	章源钨业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002389	航天彩虹	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002400	省广集团	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002402	和而泰	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002405	四维图新	1100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002413	雷科防务	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002421	达实智能	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002425	凯撒文化	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002428	云南锗业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002432	九安医疗	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002435	长江健康	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002436	兴森科技	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002437	誉衡药业	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002440	闰土股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002446	盛路通信	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002449	国星光电	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002456	欧菲光	1100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002461	珠江啤酒	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002463	沪电股份	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002467	二六三	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002472	双环传动	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002481	双塔食品	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002484	江海股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002487	大金重工	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002488	金固股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002489	浙江永强	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

002498	汉缆股份	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002516	旷达科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002518	科士达	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002522	浙江众成	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002530	金财互联	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002531	天顺风能	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002534	西子洁能	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002537	海联金汇	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002539	云图控股	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002541	鸿路钢构	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002544	普天科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002545	东方铁塔	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002550	千红制药	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002556	辉隆股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002558	巨人网络	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002567	唐人神	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002573	清新环境	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002581	未名医药	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002585	双星新材	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002589	瑞康医药	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002597	金禾实业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002605	姚记科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002609	捷顺科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002610	爱康科技	2100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002611	东方精工	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002612	朗姿股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002614	奥佳华	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002617	露笑科技	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002626	金达威	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002635	安洁科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002636	金安国纪	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002639	雪人股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002641	公元股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002643	万润股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002645	华宏科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002646	天佑德酒	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002649	博彦科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002651	利君股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002662	京威股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002664	长鹰信质	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002675	东诚药业	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

002677	浙江美大	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002695	煌上煌	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002697	红旗连锁	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002698	博实股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002706	良信股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002717	岭南股份	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002724	海洋王	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002726	龙大美食	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002727	一心堂	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002733	雄韬股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002737	葵花药业	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002738	中矿资源	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002741	光华科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002746	仙坛股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002747	埃斯顿	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002759	天际股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002761	浙江建投	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002768	国恩股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002773	康弘药业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002777	久远银海	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002782	可立克	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002792	通宇通讯	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002803	吉宏股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002807	江阴银行	1000	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002810	山东赫达	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002832	比音勒芬	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002833	弘亚数控	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002837	英维克	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002838	道恩股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002839	张家港行	800	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002847	盐津铺子	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002850	科达利	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002851	麦格米特	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002859	洁美科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002880	卫光生物	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002891	中宠股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002895	川恒股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002906	华阳集团	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002911	佛燃能源	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002912	中新赛克	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002913	奥士康	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

002918	蒙娜丽莎	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002928	华夏航空	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002929	润建股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002930	宏川智慧	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002941	新疆交建	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002950	奥美医疗	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002959	小熊电器	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002960	青鸟消防	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002961	瑞达期货	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002967	广电计量	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002970	锐明技术	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002975	博杰股份	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002977	天箭科技	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002978	安宁股份	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002979	雷赛智能	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002984	森麒麟	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002987	京北方	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
002990	盛视科技	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002991	甘源食品	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
002993	奥海科技	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
003006	百亚股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
003009	中天火箭	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
003012	东鹏控股	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
003021	兆威机电	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
003031	中瓷电子	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
003032	传智教育	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
003039	顺控发展	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
003040	楚天龙	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300006	莱美药业	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300007	汉威科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300020	银江技术	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300027	华谊兄弟	900	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300031	宝通科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300034	钢研高纳	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300035	中科电气	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300036	超图软件	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300039	上海凯宝	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300045	华力创通	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300054	鼎龙股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300055	万邦达	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300065	海兰信	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300068	南都电源	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300075	数字政通	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300077	国民技术	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300078	思创医惠	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300079	数码视讯	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300080	易成新能	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300083	创世纪	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300085	银之杰	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300087	荃银高科	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300091	金通灵	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300101	振芯科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300102	乾照光电	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300109	新开源	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300114	中航电测	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300118	东方日升	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300119	瑞普生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300123	亚光科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300127	银河磁体	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300130	新国都	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300131	英唐智控	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300132	青松股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300133	华策影视	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300134	大富科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300143	盈康生命	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300145	中金环境	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300149	睿智医药	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300151	昌红科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300158	振东制药	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300170	汉得信息	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300171	东富龙	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300177	中海达	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300180	华峰超纤	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300183	东软载波	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300184	力源信息	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300185	通裕重工	1400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300188	美亚柏科	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300191	潜能恒信	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300203	聚光科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300204	舒泰神	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300205	天喻信息	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300206	理邦仪器	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300208	青岛中程	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300215	电科院	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300219	鸿利智汇	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300222	科大智能	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300224	正海磁材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300226	上海钢联	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300229	拓尔思	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300232	洲明科技	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300233	金城医药	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300236	上海新阳	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300255	常山药业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300263	隆华科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300266	兴源环境	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300267	尔康制药	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300271	华宇软件	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300276	三丰智能	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300284	苏交科	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300287	飞利信	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300292	吴通控股	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300294	博雅生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300298	三诺生物	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300303	聚飞光电	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300307	慈星股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300311	任子行	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300318	博晖创新	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300319	麦捷科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300322	硕贝德	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300323	华灿光电	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300326	凯利泰	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300327	中颖电子	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300328	宜安科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300339	润和软件	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300343	联创股份	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300346	南大光电	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300348	长亮科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300352	北信源	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300355	蒙草生态	700	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300365	恒华科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300366	创意信息	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300368	汇金股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300369	绿盟科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300373	扬杰科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300377	赢时胜	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300378	鼎捷软件	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300379	东方通	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300382	斯莱克	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300386	飞天诚信	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300393	中来股份	400	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300394	天孚通信	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300395	菲利华	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300397	天和防务	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300398	飞凯材料	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300401	花园生物	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300406	九强生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300409	道氏技术	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300423	昇辉科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300428	立中集团	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300429	强力新材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300432	富临精工	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300438	鹏辉能源	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300439	美康生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300441	鲍斯股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300443	金雷股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300451	创业慧康	600	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300455	康拓红外	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300456	赛微电子	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300457	赢合科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300458	全志科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300459	汤姆猫	1100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300470	中密控股	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300476	胜宏科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300477	合纵科技	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300485	赛升药业	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300487	蓝晓科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300497	富祥药业	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300502	新易盛	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300510	金冠股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300523	辰安科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300525	博思软件	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300527	中船应急	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300531	优博讯	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300548	博创科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300552	万集科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300567	精测电子	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300568	星源材质	500	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300573	兴齐眼药	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300579	数字认证	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300587	天铁股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300590	移为通信	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300593	新雷能	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300596	利安隆	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300598	诚迈科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300602	飞荣达	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300604	长川科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300607	拓斯达	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300613	富瀚微	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300616	尚品宅配	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300623	捷捷微电	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300624	万兴科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300627	华测导航	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300633	开立医疗	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300634	彩讯股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300638	广和通	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300639	凯普生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300653	正海生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300655	晶瑞电材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300657	弘信电子	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300659	中孚信息	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300662	科锐国际	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300663	科蓝软件	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300666	江丰电子	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300671	富满微	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300672	国科微	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300674	宇信科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300679	电连技术	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300682	朗新科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300684	中石科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300685	艾德生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300696	爱乐达	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300702	天宇股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300709	精研科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300723	一品红	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300725	药石科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300726	宏达电子	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300735	光弘科技	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300737	科顺股份	300	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300738	奥飞数据	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300740	水羊股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300747	锐科激光	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300748	金力永磁	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300755	华致酒行	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300761	立华股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300762	上海瀚讯	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300765	新诺威	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300767	震安科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300768	迪普科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300770	新媒股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300772	运达股份	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300773	拉卡拉	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300775	三角防务	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300776	帝尔激光	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300777	中简科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300783	三只松鼠	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300785	值得买	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300788	中信出版	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300791	仙乐健康	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300792	壹网壹创	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300799	左江科技	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300803	指南针	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300815	玉禾田	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300821	东岳硅材	200	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300827	上能电气	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300829	金丹科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300841	康华生物	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300842	帝科股份	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300846	首都在线	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300850	新强联	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300855	图南股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300856	科思股份	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300857	协创数据	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300860	锋尚文化	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300861	美畅股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300867	圣元环保	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300872	天阳科技	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场

300894	火星人	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300900	广联航空	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300910	瑞丰新材	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300942	易瑞生物	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
300973	立高食品	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
300981	中红医疗	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
301015	百洋医药	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301029	怡合达	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301031	中熔电气	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301035	润丰股份	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
301039	中集车辆	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
301047	义翘神州	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301050	雷电微力	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301060	兰卫医学	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301069	凯盛新材	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301071	力量钻石	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301078	孩子王	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301080	百普赛斯	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301087	可孚医疗	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301089	拓新药业	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301090	华润材料	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
301155	海力风电	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301177	迪阿股份	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301180	万祥科技	0	必须	0%	0%	0	0	深圳市场
301217	铜冠铜箔	100	允许	10%	0%	0	0	深圳市场
600007	中国国贸	100	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600017	日照港	700	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600032	浙江新能	100	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600055	万东医疗	200	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600057	厦门象屿	500	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600059	古越龙山	300	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600063	皖维高新	600	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600072	中船科技	200	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600073	上海梅林	300	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600075	新疆天业	500	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600098	广州发展	200	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600100	同方股份	1100	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600103	青山纸业	900	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600105	永鼎股份	500	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600108	亚盛集团	700	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600110	诺德股份	600	允许	10%	20%	0	0	深圳市场

600114	东睦股份	200	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600116	三峡水利	400	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600123	兰花科创	300	允许	10%	20%	0	0	深圳市场
600125	铁龙物流	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600129	太极集团	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600151	航天机电	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600158	中体产业	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600163	中闽能源	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600169	太原重工	900	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600172	黄河旋风	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600179	安通控股	1600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600184	光电股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600185	格力地产	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600197	伊力特	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600206	有研新材	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600210	紫江企业	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600211	西藏药业	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600217	中再资环	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600223	鲁商发展	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600246	万通发展	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600248	陕西建工	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600252	中恒集团	1300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600261	阳光照明	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600266	城建发展	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600267	海正药业	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600273	嘉化能源	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600277	亿利洁能	1000	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600284	浦东建设	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600285	羚锐制药	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600295	鄂尔多斯	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600305	恒顺醋业	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600308	华泰股份	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600320	振华重工	900	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600323	瀚蓝环境	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600326	西藏天路	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600328	中盐化工	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600330	天通股份	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600331	宏达股份	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600335	国机汽车	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600337	美克家居	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600338	西藏珠峰	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场

600343	航天动力	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600360	华微电子	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600363	联创光电	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600366	宁波韵升	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600378	昊华科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600389	江山股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600391	航发科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600395	盘江股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600416	湘电股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600420	国药现代	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600422	昆药集团	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600428	中远海特	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600449	宁夏建材	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600452	涪陵电力	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600456	宝钛股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600458	时代新材	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600459	贵研铂业	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600477	杭萧钢构	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600480	凌云股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600481	双良节能	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600483	福能股份	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600490	鹏欣资源	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600491	龙元建设	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600496	精工钢构	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600502	安徽建工	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600510	黑牡丹	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600512	腾达建设	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600523	贵航股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600531	豫光金铅	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600548	深高速	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600550	保变电气	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600552	凯盛科技	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600557	康缘药业	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600559	老白干酒	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600562	国睿科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600565	迪马股份	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600569	安阳钢铁	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600575	淮河能源	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600577	精达股份	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600578	京能电力	900	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600581	八一钢铁	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场

600583	海油工程	1000	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600586	金晶科技	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600587	新华医疗	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600590	泰豪科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600596	新安股份	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600602	云赛智联	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600604	市北高新	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600610	中毅达	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600612	老凤祥	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600618	氯碱化工	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600621	华鑫股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600635	大众公用	900	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600639	浦东金桥	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600641	万业企业	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600643	爱建集团	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600645	中源协和	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600649	城投控股	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600657	信达地产	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600662	外服控股	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600675	中华企业	800	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600682	南京新百	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600685	中船防务	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600688	上海石化	1000	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600691	阳煤化工	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600694	大商股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600696	岩石股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600710	苏美达	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600711	盛屯矿业	1000	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600715	文投控股	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600720	祁连山	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600729	重庆百货	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600740	山西焦化	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600742	一汽富维	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600746	江苏索普	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600748	上实发展	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600750	江中药业	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600751	海航科技	800	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600761	安徽合力	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600770	综艺股份	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600771	广誉远	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600773	西藏城投	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场

600775	南京熊猫	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600776	东方通信	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600777	新潮能源	2500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600783	鲁信创投	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600789	鲁抗医药	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600797	浙大网新	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600800	渤海化学	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600810	神马股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600812	华北制药	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600821	金开新能	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600841	动力新科	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600850	电科数字	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600855	航天长峰	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600864	哈投股份	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600869	远东股份	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600872	中炬高新	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600873	梅花生物	1100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600874	创业环保	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600876	洛阳玻璃	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600877	声光电科	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600882	妙可蓝多	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600888	新疆众和	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600903	贵州燃气	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600908	无锡银行	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600916	中国黄金	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600929	雪天盐业	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600933	爱柯迪	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600935	华塑股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600955	维远股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600963	岳阳林纸	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600966	博汇纸业	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600971	恒源煤电	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600977	中国电影	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600984	建设机械	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600986	浙文互联	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600990	四创电子	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600993	马应龙	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600996	贵广网络	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
600997	开滦股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601001	晋控煤业	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601011	宝泰隆	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场

601015	陕西黑猫	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601028	玉龙股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601069	西部黄金	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601099	太平洋	3100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601126	四方股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601137	博威合金	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601158	重庆水务	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601208	东材科技	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601212	白银有色	1400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601222	林洋能源	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601231	环旭电子	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601258	庞大集团	3800	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601279	英利汽车	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601311	骆驼股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601330	绿色动力	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601369	陕鼓动力	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601375	中原证券	1300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601399	国机重装	1300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601515	东风股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601519	大智慧	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601528	瑞丰银行	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601567	三星医疗	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601588	北辰实业	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601606	长城军工	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601609	金田股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601619	嘉泽新能	600	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601666	平煤股份	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601677	明泰铝业	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601678	滨化股份	800	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601686	友发集团	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601700	风范股份	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601702	华峰铝业	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601777	力帆科技	800	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601827	三峰环境	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601882	海天精工	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601886	江河集团	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601890	亚星锚链	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601908	京运通	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601918	新集能源	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601921	浙版传媒	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601929	吉视传媒	1100	允许	10%	20%	0	0	上海市场

601949	中国出版	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601952	苏垦农发	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601963	重庆银行	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
601965	中国汽研	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603005	晶方科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603008	喜临门	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603010	万盛股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603013	亚普股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603018	华设集团	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603025	大豪科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603027	千禾味业	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603033	三维股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603043	广州酒家	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603053	成都燃气	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603055	台华新材	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603060	国检集团	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603063	禾望电气	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603068	博通集成	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603071	物产环能	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603093	南华期货	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603098	森特股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603103	横店影视	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603105	芯能科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603108	润达医疗	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603113	金能科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603118	共进股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603128	华贸物流	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603129	春风动力	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603169	兰石重装	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603171	税友股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603179	新泉股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603180	金牌厨柜	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603187	海容冷链	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603208	江山欧派	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603212	赛伍技术	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603222	济民医疗	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603229	奥翔药业	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603236	移远通信	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603258	电魂网络	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603279	景津装备	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603298	杭叉集团	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场

603299	苏盐井神	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603301	振德医疗	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603305	旭升股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603306	华懋科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603308	应流股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603313	梦百合	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603323	苏农银行	700	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603328	依顿电子	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603337	杰克股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603338	浙江鼎力	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603348	文灿股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603359	东珠生态	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603363	傲农生物	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603368	柳药集团	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603378	亚士创能	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603387	基蛋生物	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603393	新天然气	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603396	金辰股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603416	信捷电气	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603429	集友股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603439	贵州三力	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603466	风语筑	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603489	八方股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603505	金石资源	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603508	思维列控	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603511	爱慕股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
603520	司太立	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603529	爱玛科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603530	神马电力	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603533	掌阅科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603565	中谷物流	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603566	普莱柯	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603567	珍宝岛	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603583	捷昌驱动	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603587	地素时尚	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603588	高能环境	400	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603595	东尼电子	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603596	伯特利	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603599	广信股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603601	再升科技	300	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603606	东方电缆	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场

603609	禾丰股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603610	麒盛科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603612	索通发展	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603626	科森科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603636	南威软件	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603666	亿嘉和	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603678	火炬电子	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603686	福龙马	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603688	石英股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603690	至纯科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603693	江苏新能	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603713	密尔克卫	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603718	海利生物	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603728	鸣志电器	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603730	岱美股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603733	仙鹤股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603766	隆鑫通用	500	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603801	志邦家居	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603826	坤彩科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603876	鼎胜新材	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603877	太平鸟	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603881	数据港	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603896	寿仙谷	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603906	龙蟠科技	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603915	国茂股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603916	苏博特	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603919	金徽酒	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603920	世运电路	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603936	博敏电子	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603959	百利科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603960	克来机电	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603979	金诚信	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603989	艾华集团	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603995	甬金股份	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
603997	继峰股份	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605007	五洲特纸	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605008	长鸿高科	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605009	豪悦护理	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605090	九丰能源	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605099	共创草坪	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605111	新洁能	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场

605123	派克新材	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605136	丽人丽妆	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605168	三人行	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605199	葫芦娃	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605222	起帆电缆	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605296	神农集团	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605338	巴比食品	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605339	南侨食品	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605365	立达信	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605369	拱东医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
605376	博迁新材	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605388	均瑶健康	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605507	国邦医药	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
605589	圣泉集团	100	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688001	华兴源创	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688007	光峰科技	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688016	心脉医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688017	绿的谐波	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688018	乐鑫科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688019	安集科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688020	方邦股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688023	安恒信息	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688027	国盾量子	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688033	天宜上佳	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688037	芯源微	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688050	爱博医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688055	龙腾光电	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688063	派能科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688066	航天宏图	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688083	中望软件	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688085	三友医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688095	福昕软件	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688100	威胜信息	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688106	金宏气体	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688116	天奈科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688127	蓝特光学	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688128	中国电研	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688133	泰坦科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688139	海尔生物	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688158	优刻得	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688166	博瑞医药	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场

688198	佰仁医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688200	华峰测控	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688202	美迪西	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688222	成都先导	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688233	神工股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688266	泽璟制药	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688268	华特气体	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688277	天智航	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688278	特宝生物	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688298	东方生物	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688301	奕瑞科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688315	诺禾致源	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688318	财富趋势	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688333	铂力特	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688339	亿华通	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688356	键凯科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688365	光云科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688366	昊海生科	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688368	晶丰明源	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688383	新益昌	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688388	嘉元科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688389	普门科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688399	硕世生物	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688408	中信博	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688505	复旦张江	200	允许	10%	20%	0	0	上海市场
688508	芯朋微	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688516	奥特维	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688520	神州细胞	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688526	科前生物	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688568	中科星图	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688578	艾力斯	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688586	江航装备	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688598	金博股份	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688608	恒玄科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688617	惠泰医疗	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688680	海优新材	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688686	奥普特	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688696	极米科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688699	明微电子	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
688788	科思科技	0	必须	0%	0%	0	0	上海市场
159900	申赎现金	0	必须	0%	0%	1237636.4	900099.2	深圳市场

申购赎回清单的具体内容与格式以深圳证券交易所届时规定为准。基金管理人有权根据业务需要及交易所规则的调整对申购赎回清单的格式进行修改。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资者的申购申请。

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

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

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。

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

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

7、基金管理人根据市场情况在申购赎回清单中设置申购上限且当日总申购份额达到基金管理人所设定的上限。

8、基金管理人设定单个投资人累计持有的基金份额上限、单日或单笔申购份额上限和净申购比例上限且当日单个投资人的申购达到基金管理人所设定的上限。

9、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。

10、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 6、7、8 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人不能支付赎回对价。

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

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

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。

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

6、基金管理人根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回上限且当日总赎回份额达到基金管理人所设定的上限。

7、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。

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

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 6 项以外的情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价时,基金管理人应根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告。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、基金份额的非交易过户等其他业务

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

在条件许可的情况下,登记机构可依据相关法律法规及其业务规则,办理基金份额质押业务,并可收取一定的手续费。

十一、其他申购赎回方式

1、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,基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务,场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

2、在条件允许时,基金管理人履行适当程序后,可开放集合申购,即允许多个或单个投资者集合其持有的组合证券或单券,共同构成最小申购赎回单位或其整数倍,进行申购。

3、在条件允许时,基金管理人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,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。

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

5、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。

十二、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。

十三、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，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在本基金的招募说明书及其更新中予以更新，无需召开基金份额持有人大会审议。

十四、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在对基金份额持有人利益实质性不利影响的前提下，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，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十一部分 基金份额的登记

一、基金份额的登记业务

本基金的登记业务指《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》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务。

二、基金登记业务办理机构

本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金管理人应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

三、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间及规则进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告；
- 5、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。

四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律

法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形除外；

5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、如因登记机构的原因而造成基金管理人或者基金份额持有人损失的，依法承担相应的赔偿责任；

8、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。

第十二部分 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

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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

三、投资策略

本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响；（5）由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整；（6）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

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

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

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

2、存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

4、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略

对于可转换债券的投资，本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益；本基金将重点关注可转债的转换价值、市场价值与其转换价值的比较、转换期限、公司经营业绩、公司当前股票价格、相关的赎回条件、回售条件等。

可交换债券是一种风险收益特性与可转换债券相类似的债券品种。两者相同点在于都可以以特定价格转换成公司的股票。两者均一方面有票息、期限、到期还本付息等债性的特征，另一方面有与转股标的相关联的股性特征，且都带有一定的回售和赎回条款。区别在于同一转股标的的可交换债券和可转换债券的发行主体是不同的。可交换债券的转股标的是发行人所持有的其他公司股票，而可转换债券的转股标的为发行人自身股票。因此，在条款博弈、债性分析属性等方面，两者还存在着差异。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指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、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7、股票期权投资策略

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

8、参与融资及转融通证券出借业务策略

本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本

基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、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，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

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

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

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

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

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

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

(8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金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；

本基金参与股指期货交易的，应当遵循下列（10）-（14）要求：

(10) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

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

本基金参与股票期权交易的，应当遵守下列（15）-（17）要求：

(15) 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%；

(16) 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；

(17) 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；

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

(19) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；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；

(20) 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；

(21) 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；

(22) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(23) 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；

(24) 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)、(19) 至 (21) 情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第 (19) 项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他活动。

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

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行。

五、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证 1000 指数。

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

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

2、标的指数编制方案及查询途径

中证 1000 指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动

性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

(1) 指数名称和代码

指数名称：中证 1000 指数

指数简称：中证 1000

英文名称：CSI 1000 Index

英文简称：CSI 1000

指数代码：000852

(2) 指数基日和基点

该指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。

(3) 样本选取方法

(A) 样本空间

同中证全指指数的样本空间

(B) 选样方法

①剔除样本空间内中证 800 指数样本股及过去一年(新股为上市以来,下同)日均总市值排名前 300 名的股票;

②将样本空间股票按照过去一年的过去一年日均成交金额由高到低排名,剔除排名后 20%的股票;

③将剩余股票按照过去一年日均总市值由高到低进行排名,选取排名在前 1000 名的股票作为中证 1000 指数样本股。

(4) 指数计算

中证 1000 指数计算公式为:

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

其中, 调整市值 = Σ (股价 × 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。

(5) 指数样本和权重调整

(A) 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。对于中证 1000 指数，每次调整的样本比例一般不超过 10%。样本调整设置缓冲区，日均成交金额排名在样本空间前 90%的老样本可参加下一步日均总市值排名；日均总市值排名在 800 名内的新样本优先进入，排名在 1200 名之前的老样本优先保留。

(B) 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。

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

3、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形履行对应适当程序，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上刊登公告。

六、风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

第十三部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十四部分 基金资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、股指期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、资产支持证券、应收款项、其他投资等资产及负债。

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。

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

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

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

进行调整并确定公允价值。

四、估值方法

1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

（3）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；

（4）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。对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

3、处于未上市期间以及流通受限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）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于

活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

(4) 流通受限股票，包括非公开发行股票、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。

4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

5、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。

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

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

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、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，基金托管人承担复核责任，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見，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布，基金托管人不承担基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露的责任。

五、估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金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。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、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工作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信息予以公布。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记机构、指数编制机构

及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

3、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

第十五部分 基金的收益与分配

一、基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

二、收益分配方案

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

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，在 2 日内在规定媒介公告。

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。

第十六部分 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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货和股票期权等交易、结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费用、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 9、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用，银行账户维护费用；
- 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 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金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、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金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、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用，不从基金财产中列支：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、由基金管理人承担的基金标的指数许可使用费；

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项纳税主体，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。

第十七部分 基金的会计与审计

一、基金的会计政策

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

二、基金的年度审计

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

第十八部分 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披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券、期货投资业绩进行预测；
- 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。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，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

（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) 基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回或上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日,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/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应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。

(五) 基金份额上市交易公告书

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。

(七) 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,通过其网站以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

(八) 基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金合同生效后,本基金可以进行份额折算。基金管理人有权确定基金份额折算日,并提前公告。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后,基金管理人应

将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

（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过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

（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在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所

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，中国证监会另有规定的情形除外；

14、基金收益分配事项；

15、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；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、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；

21、基金份额的折算；

- 22、本基金推出新业务或服务；
- 23、基金停牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易；
- 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、基金合同生效后，如存在连续 30、40、45 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形或不满 200 人的，基金管理人就基金合同可能出现终止事由发布提示性公告；
- 26、调整基金份额类别的设置；
- 27、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（十一）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基金上市交易的证券交易所。

（十二）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。

（十三）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。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。

（十四）中国证监会规定的其他信息

1、投资资产支持证券的信息

本基金投资资产支持证券的，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。

2、投资股指期货和股票期权的信息

本基金投资于股指期货和股票期权的，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）等文件中披露股指期货和股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货和股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

3、参与融资及转融通证券出借业务的信息

若本基金参与融资及转融通证券出借业务，应当在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情况，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。

4、本基金投资存托凭证的，信息披露依照境内上市交易的股票执行。

（十五）相关法律法规关于上述信息披露的规定发生变化时，基金管理人将按最新规定进行信息披露。

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者电子确认。

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、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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。

七、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

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交易时；

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或无法进行信息披露时；

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暂停估值的；

4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

八、信息披露文件的存放与查阅

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

第十九部分 风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

（一）特有风险

1、指数化投资的风险

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2、标的指数的风险

（1）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。

（2）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。

（3）标的指数值计算出错的风险

尽管中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

（4）标的指数编制方案带来的风险

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

（5）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金基于原标的指数的投资政策可能会改变，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）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，当成份股发生停牌等流动性约束情形时，本基金可能面临如下风险：

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平；投资者可能由于无法买入成份股而影响溢价套利或无法卖出成份股而影响折价套利。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，且设置了现金替代比例上限。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。

3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差；

4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险。

（7）指数编制机构停止服务的风险

本基金标的指数的编制机构为中证指数有限公司，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。

如指数编制机构停止服务，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合

并，或者终止基金合同等风险。

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

3、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

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

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

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

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

(7) 基金现金资产的拖累会影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(8) 特殊情况下，如果本基金采取成份股替代策略，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。

(9) 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、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。

5、套利风险

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

6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托的机构可以在交易时间内，根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向深圳证券交易所发送，由深圳证券交易所对外发布，仅供投资者交易、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，与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异，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。

7、申购赎回清单差错风险

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

8、申购及赎回风险

（1）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，且设置了现金替代比例上限。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。

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

(3) 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、现金替代、现金差额等，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。

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、终止清盘风险

基金合同生效后，连续 50 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

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

因而，本基金存在着无法存续的风险。

11、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

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

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

3) 第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

12、本基金投资特定品种的特有风险

(1) 资产支持证券的投资风险

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是受托机构发行的、代表特定目的信托的信托受益权份额。受托机构以信托财产为限向投资机构承担支付资产支持证券收益的义务，其支付主要来源于支持证券的资产池产生的现金流。资产支持证券在二级市场的成交流动性情况差异较大，投资者可能面临资产支持证券难以以合理价格变现进而遭受损失的情况。资产支持证券虽然在法律上实现了与原始权益人的破产隔离，但仍然依赖原始权益人的持续运营，并面临与原始权益人的资金混同风险，因此当资产支持证券的原始权益人出现违规违约时，本基金作为资产支持证券的持有人可能面临无法收取投资收益甚至损失本金的风险。资产支持证券的交易结构较为复杂，涉及众多交易方，虽然相关的交易文件对交易各方的权利和义务均有详细的规定，但是无法排除由于任何一方违约或发生重大不利变化导致投资者利益损失的风险。此外在资产支持证券的投资中基金管理人还面临现金流预测风险、操作风险等。当本基金投资的资产支持证券信用评级发生变动不再符合法规规定或基金合同约定时，管理人将需要在规定期限内完成调整，该调整也可能导致或有的变现损失。

(2) 股指期货、股票期权等金融衍生品投资风险

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

(3) 参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务，可能面临以下风险：

1) 杠杆风险：融资交易利用了一定的财务杠杆，放大了证券投资的盈亏比例，由于高杠杆特征，潜在损失可能成倍放大；

2) 强制平仓风险：在从事融资交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与其融资债务之间的比例低于维持担保比例，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险；

3) 授信额度风险：授信额度是客户可融资额的最高限额，如果证券公司融资总额规模或证券品种融资交易受限，则存在授信给投资者的融资额度在某一时点无法足额使用的可能。另外，如果其信用资质状况降低，证券公司会相应降低对其的授信额度，或者证券公司提高相关警戒指标、平仓指标所产生的风险，可能会给基金财产造成经济损失；

4) 融资成本增加的风险：在从事融资交易期间，如果中国人民银行规定的同期金融机构贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率，将面临融资成本增加的风险；

5) 标的证券暂停交易或终止上市的风险：在从事融资交易期间，如果发生融资标的证券范围调整、标的证券暂停交易或终止上市等情况，投资者将可能面临被证券公司提前了结融资交易的风险，可能会给基金财产造成经济损失。。

(4) 参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的的风险包括但不限于：1) 流动性风险，指面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回对价的风险；2) 信用风险，指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，指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；4) 其他风险，如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

(5) 存托凭证的投资风险

本基金投资存托凭证的，在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

1) 与存托凭证相关的风险

①存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

②本基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，本基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

③本基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；本基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

④存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对本基金生效。本基金可能无法对此行使表决权。

⑤存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，本基金可能存在失去应有权利的风险。

⑥存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

⑦存托凭证退市的，本基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，本基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为本基金提供相应服务等风险。

2) 与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

3) 与境外发行人相关的风险

①红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

②红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

③红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

4) 与交易机制相关的风险

①境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

②红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

③在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

④本基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；本基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

13、税负增加风险

财政部、国家税务总局财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于基金合同中基金管理人的管理费中不包括产品运营过程中发生的税款，本基金运营过程中需要缴纳增值税应税的，将由基金份额持有人承担并从基金资产中支付，按照税务机关的规定以基金管理人为增值税纳税人履行纳税义务，因此可能增加基金份额持有人的投资税费成本。

(二) 市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

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

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。因此基金投资收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

6、债券收益率曲线变动风险

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

7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得

较少的收益率。

（三）流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回对价的风险。

1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括中证 1000 指数的成份股、备选成份股、其他股票、存托凭证、债券、衍生工具和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对基金份额持有人赎回的情形时，基金管理人将以保障基金份额持有人合法权益为前提，按照法律法规、基金合同等规定，选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将对风险进行监测和评估，使用前与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回对价支付等可能受到相应影响，基金管理人将依照法律法规、基金合同等规定进行操作，保障基金份额持有人的合法权益。

3、本基金最小申购赎回单位设置较高，中小投资者只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。

4、基金将在深圳证券交易所上市交易，但不保证市场交易一定活跃；基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

5、尽管由于投资者可以进行申购、赎回，基金一般不会持续出现大幅折溢价情况。但是，基金的二级市场交易价格受市场供求的影响，可能高于（称为溢价）或低于（称为折价）基金份额净值。

（四）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

（五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

（六）操作风险

1、指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

2、基金估值风险。指每日基金估值可能发生错误的风险。

（七）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

（八）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

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据相关法律法规及内部评级标准，将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。

同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。

敬请投资者知悉，在购买本基金时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，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，自主作出投资决策。

（九）其他风险

1、不可抗力。战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。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，使投资人和基金份额持有人无法及时查询权益、进行日常交易以致利益受损。

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

3、其他意外事件导致的风险。

二、声明

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

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金销售机构公开发售，基金管理人及基金销售机构都不保证其收益或本金安全。

第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

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

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

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、连续 50 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；

5、基金合同约定的其他情形；

6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会

指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

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

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规

的规定。

第二十一部分 基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律规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、赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和收益分配等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、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，确定基金份额申购对价、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，以及根据监管机构、司法机关等有权机关的要求或因审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付投资者赎回对价；

(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，保存时间不低于法律法规的规定；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，

基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人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、期货等交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的

基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(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，保存期限不少于法律法规的规定；

(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。

(三) 基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金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、基金产品资料概要等信息披露文件；

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

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购款项和认购股票、申购对价、赎回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、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行。

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接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。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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份额持有人大会。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

（一）召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同，基金合同另有约定的除外；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面

要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或者变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、相关证券交易所、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等内容；

(7) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(8) 调整基金份额净值、申购赎回清单的内容、计算和公告的时间或频率；

(9) 调整基金收益分配原则；

(10) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通跨系统转托管等业务；

(11) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管

理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（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，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。

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

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表

决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

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

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、连续 50 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；
- 5、基金合同约定的其他情形；
- 6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清

算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规的规定。

四、争议解决方式

（一）各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照申请仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

（二）基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

第二十二部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：富国基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

法定代表人：裴长江

成立时间：1999 年 4 月 13 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字【1999】11 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.2 亿元人民币

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发

行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

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

基金管理人应将拟投资的中证 1000 指数股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资

品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督：

(1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

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

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

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

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

(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最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金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；

本基金参与股指期货交易的，应当遵循下列（10）-（14）要求：

(10) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(11) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质

押式回购)等;

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

(13) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当不低于基金资产净值的 90%;

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

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

(16) 本基金参与转融通证券出借业务的,应当符合下列要求:最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元;参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%,其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券归为流动性受限资产;参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%;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;

(18) 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;

(19) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(20) 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;

(21) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述(6)、(16)至(18)情形之外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金

管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（16）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。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。期间，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上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，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，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需另行召开基金份额持有人大会。

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。

本基金参与转融通出借业务，基金管理人应当遵循审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，完善业务流程，有效防范和控制风险。基金托管人将根据本协议前款第（16）条约约定的比例和限额对基金参与转融通出借业务进行监督和复核。

（二）基金托管人应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、相关信息披露登载基金业绩表现数据等进行复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认

并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四)基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定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指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(五)基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人应对基金托管人的业务核查

(一)在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，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和证券账户、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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

(三)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。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，分账管理，独立核算，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金合同生效前募集资金及股票的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，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方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记机构应予以解冻。

（三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用

本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

(四) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

(五) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，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责任公司开设证券账户。

2、本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或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(六) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以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设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

(七) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责

妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽量保证基金一方持有两份以上的正本，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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管，保管期限不少于法律法规的规定。

五、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每个工作日对基金财产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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估值日结束后计算得出当日的基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人按规定对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达

到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通知基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人在报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金管理人对外公布的基金净值经基金托管人复核同意的，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任，基金托管人不承担基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露产生的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所、期货交易所、登记机构、指数编制机构及存款银行发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和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。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

七、争议解决方式

(一) 本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

(二) 基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其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。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

(三) 除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、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

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

(二) 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

(三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

第二十三部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

一、基金份额持有人交易资料服务

投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后，可通过销售网点查询和打印交易确认单。基金管理人将根据持有人账单订制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人定期或不定期发送对账单。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

二、网上交易、查询服务

投资者除可通过基金管理人的直销网点和代销机构的代销网点办理申购、赎回等交易以及账户查询外，还可通过基金管理人的网站（www.fullgoal.com.cn）微信公众号（搜索“富国基金微管家”或“FullgoalWeFund”）、或客户端“富国富钱包”APP 享受网上交易、查询服务。具体业务规则详见基金管理人网站公告或相关说明。

三、信息定制及资讯服务

投资者可通过拨打客服热线、在线客服、发送邮件、短信或登陆基金管理人网站等多种渠道，定制对账单、基金交易确认信息、周刊等各类资讯服务。当投资者接收定制服务的手机号码、电子邮箱、邮寄地址等信息不详、填写有误或发生变更时，可通过以上渠道更新修改，以避免无法及时接收相关定制服务。

四、网络在线服务

投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、信息定制、服务投诉及建议等多项在线服务。

五、客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工坐席提供每周 5 天、每天不少于 8 小时的座席服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等

专项服务，节假日除外。

六、客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金公司网站投诉栏目、客户服务中心人工热线、在线客服、微客服、书信、电子邮件、短信、传真等多渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及公司的政策规定提出投诉或意见。

七、基金管理人个人信息保护政策

投资者因订立、履行基金合同所必需或基金管理人因遵守反洗钱、投资者适当性管理、实名制等相关法律法规及监管规定履行法定义务所必需，在账户开立及基金交易时涉及个人信息处理。投资者可以通过基金管理人网站、微信服务号(搜索“富国基金微管家”或“FullgoalWeFund”)、客户端“富国富钱包”APP 查看《富国基金个人信息保护政策》，了解基金管理人处理个人信息的规则。

八、基金管理人客户服务联络方式

客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费），工作时间内可转人工坐席。

客户服务传真：021-20513277

公司网址：<http://www.fullgoal.com.cn>

电子信箱：public@fullgoal.com.cn

客服中心地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27 层

九、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。

第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

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。

第二十五部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

（二）《富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集注册富国中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的法律意见

（七）注册登记协议

（八）中国证监会要求的其他文件

富国基金管理有限公司

2022 年 7 月 15 日