浦银基金管理有限公司

浦银北证50成份指数型发起式证券投资基金

招募说明书（更新）

2026年第2号

基金管理人：浦银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请已于 2025 年 6 月 16 日经中国证监会证监许可〔2025〕1264 号文准予注册。

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的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金标的指数为北证 50 成份指数，具体如下：

1、样本空间

北证 50 成份指数样本空间由在审核截止日同时满足以下条件的北交所上市公司证券组成：

（1）上市时间超过 6 个月，上市以来日均总市值排名在北交所市场前 5 名且发行总市值超过 100 亿元的除外；待北交所上市满 12 个月的上市公司证券数量达 200 只至 300 只后，上市时间调整为超过 12 个月；

（2）非退市风险警示及其他风险警示类上市公司证券。

2、选样方法

北证 50 成份指数样本按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、价格无明显异常波动或市场操纵的上市公司证券：

（1）对样本空间内的证券按照过去六个月的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；

（2）对剩余证券按照过去六个月的日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券，构成最新一期北证 50 指数样本。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见北京证券交易所和中证指数有限公司网站（http://www.bse.cn、http://www.csindex.com.cn）。

本基金投资于证券/期货市场，基金净值会因为证券/期货市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品

特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、流动性风险、管理风险、操作和技术风险、合规性风险、本基金特有风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、其他风险等。

本基金可能投资于资产支持证券。本基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

本基金可进行股指期货和国债期货交易，股指期货和国债期货作为金融衍生品，具备一些特有的风险点。进行股指期货和国债期货交易所面临的主要风险是市场风险、流动性风险和基差风险。

本基金可参与股票期权交易，股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

本基金可参与融资业务，面临的风险包括但不限于：投资风险、合规风险及其他风险。

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：信用风险、市场风险及其他风险。

本基金投资北京证券交易所股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，详见招募说明书“风险揭示”部分。

本基金资产可投资于科创板，若本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

本基金资产可投资于存托凭证，会面临与境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于企业业务持续能力和盈利能力

等经营风险；存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

本基金的流动性风险主要体现为基金申购、赎回等因素对基金造成的流动性影响。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

本基金为股票型基金，其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。

本基金为指数型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“第十七部分 风险揭示”。

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易，并由选定的证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

本基金为发起式基金，在基金募集时，发起资金提供方将运用发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时，发起资金提供方有可能赎回认购的本基金份额。自基金合同生效之日起满三年后的对应日（指自然日），如果本基金的

资产净值低于 2 亿元，基金合同将自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限。

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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”的相关内容。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金本次更新招募说明书主要涉及基金管理人名称和基金名称等变更，本基金管理人对招募说明书相应内容进行了更新，相关信息更新截止日为 2026 年 8 月 14 日。本招募说明书其他所载内容本次未更新。除非另有说明，本招募说明书其余所载内容截止日为 2026 年 6 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日 2026 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目　　录

第一部分 绪言 6
第二部分 释义 7
第三部分 基金管理人 13
第四部分 基金托管人 26
第五部分 相关服务机构 29
第六部分 基金的募集 32
第七部分 基金合同的生效 33
第八部分 基金份额的申购与赎回 34
第九部分 基金的投资 47
第十部分 基金的财产 62
第十一部分　基金资产估值 63
第十二部分　基金费用与税收 70
第十三部分　基金的收益与分配 73
第十四部分　基金的会计与审计 75
第十五部分　基金的信息披露 76
第十六部分　侧袋机制 84
第十七部分　风险揭示 87
第十八部分　基金合同的变更、终止与基金财产的清算 100
第十九部分　基金合同的内容摘要 103
第二十部分　基金托管协议内容摘要 131
第二十一部分　对基金份额持有人的服务 152
第二十二部分　其他应披露事项 154
第二十三部分　招募说明书的存放及查阅方式 157
第二十四部分　备查文件 158

第一部分 绪言

《浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）由浦银基金管理有限公司依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集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《浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了浦银北证 50 成份指数型发起式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全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

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：指浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金

2、基金管理人：指浦银基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同或《基金合同》：指《浦银北证 50 成份指数型发起式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、托管协议或《托管协议》：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《浦银北证 50 成份指数型发起式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、《招募说明书》或本招募说明书：指《浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

9、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

10、《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

11、《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》及其配套规则以及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

日实施的，并经2020年3月20日中国证监会第166号令《关于修改部分证券期货规章的决定》修订的《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

13、《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

14、《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

15、《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

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

18、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

19、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

20、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

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

22、发起式基金：指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，下同）等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

23、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人股东资金、基金

管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于三年

24、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

25、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方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、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等业务

28、销售机构：指浦银基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

29、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

30、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为浦银基金管理有限公司或接受浦银基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

31、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

32、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

33、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

34、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

35、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

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所等相关交易场所的正常交易日

38、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

39、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

40、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

41、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

42、《业务规则》：指《浦银基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

43、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

44、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

45、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

46、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

47、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

48、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

50、标的指数：指北证50成份指数及其未来可能发生的变更

51、元：指人民币元

52、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

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

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、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

56、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

57、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

58、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

59、基金份额分类：本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值

60、A 类基金份额：指在投资者认购/申购基金份额时收取认购/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

61、C 类基金份额：指在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

62、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

63、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（以下简称“规定报刊”）以及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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

64、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

65、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

66、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

67、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：浦银基金管理有限公司（简称“本公司”）

住所：中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

成立时间：2007 年 8 月 5 日

法定代表人：张健

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

注册资本：人民币 120,000 万元

股权结构：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）持有 51%的股权；法国巴黎资产管理控股公司持有 39%的股权；上海国盛集团资产有限公司持有 10%的股权。

电话：（021）23212888

传真：（021）23212800

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

网址：www.spdbfunds.com

联系人：徐薇

二、主要人员情况

（一）董事会成员

张健先生，董事长。上海交通大学企业管理学博士。1999 年 3 月进入上海浦东发展银行，曾任总行金融市场部副总经理，总行办公室副主任，上海分行党委副书记、纪委书记，上海分行党委副书记、副行长，南昌分行党委书记、行长，郑州分行党委书记、行长，总行资产负债管理部总经理、总行资产负债管理党委书记，总行资产负债与财务管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长、董事会秘书。2024 年 12 月起，担任本公司董事及董事长。

Pierre-Axel Margulies 先生，董事。法国国籍，法国里昂商学院，公司金融专业管理学硕士。2016 年参加欧洲工商管理学院 MBA 项目。2012 年至 2015 年

进入通用资本担任商业发展部副总监，负责收购及并购业务。2016 年加入布鲁克菲尔德资产管理投资银行， 2017 加入贝恩公司任顾问。2018 年至今加入安盛投资，2018 年至 2019 年任战略与企业财务官，2020 年起至 2022 年 8 月任总裁办公室主任。现任安盛投资中国区经理。2022 年 8 月至 2025 年 12 月担任上海浦银安盛资产管理有限公司监事。2022 年 8 月起，担任本公司董事。

黄雄先生，董事。复旦大学西方经济学硕士。曾任上海市浦东新区发展和改革委员会产业发展处主任科员、综合发展规划处主任科员，上海市政府办公厅秘书处主任科员、电子政务办公室副主任。2020 年 2 月至 2022 年 12 月，任上海国盛集团资产有限公司党委委员、副总裁。2022 年 12 月起至今，任上海国盛集团资产有限公司党委副书记、总裁、董事。2026 年 5 月起，担任本公司董事。

杨志敏先生，董事。宁波大学英语专业学士，经济师。曾任中国工商银行温州市分行平阳支行副行长（主持工作）、党总支副书记，平阳支行行长、党总支书记。2007 年 2 月进入浦发银行，曾任温州分行银行卡及渠道部总经理，温州分行个人银行发展部负责人，总行个人银行总部市场企划部总经理，总行零售业务管理部（移动金融部）副总经理，总行零售业务管理部副总经理，总行第一直属党委委员，总行零售业务部副总经理，总行第一直属党委委员，总行财富管理与私人银行部总经理。现任上海浦东发展银行总行私人银行部总经理。2024 年 12 月起，担任本公司董事。

侯林先生，董事。南开大学工商管理学硕士，高级经济师。曾就职于天津信托投资公司，任信托业务综合部副总经理，市场开发部副总经理，证券投资信托业务部总经理。2003 年 1 月进入浦发银行，曾任天津分行个人金融业务部副总经理，天津分行浦安支行副行长，天津分行资金财务部副总经理、总经理，总行资金总部总经理助理。现任上海浦东发展银行总行金融市场部副总经理。2024 年 12 月起，担任本公司董事。

Romain Zhang 先生，董事。法国国籍，法国里昂高等商学院管理学硕士。2010 年 9 月至 2018 年 9 月期间，曾先后就职于普华永道会计师事务所，担任高级财务审计师；及安永会计师事务所，担任交易咨询服务经理。2018 年 9 月加入法国巴黎银行，担任集团发展与战略部企业发展官。2024 年 4 月起至今，任

法国巴黎资产管理控股公司参股业务总监。2026年7月起，担任本公司董事。

张弛先生，董事，总经理。英国兰卡斯特大学金融学硕士。曾在中国建设银行股份有限公司和华安基金管理有限公司就职。后在光大保德信基金管理有限公司担任副总经理兼首席市场总监；在泰康资产管理有限责任公司担任副总经理、首席产品官、董事总经理及执行委员会成员等职务；在贝莱德投资管理（上海）有限公司担任董事总经理职务；在贝莱德基金管理有限公司担任代理董事长、董事、总经理、法定代表人等职务。2024年7月起，担任本公司董事、总经理之职。

韩启蒙先生，独立董事。法国岗城大学法学博士。1995年4月加盟基德律师事务所担任律师。2001年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006年1月至2011年9月，担任基德律师事务所全球合伙人。2011年11月起至今，任上海启恒律师事务所合伙人，兼任上海同城会文化传播有限公司监事职务。2013年2月起，担任本公司独立董事。

赵晓菊女士，独立董事。上海财经大学金融专业学士，上海社会科学院世界经济研究所博士。1973年参加工作。1983年2月起任职于上海财经大学金融学院，先后任助教，讲师，副教授，副院长，常务副院长，博士生导师。赵晓菊女士曾担任上海财经大学上海国际金融中心研究院执行院长、院长，上海国际银行金融学院首任院长、执行董事，上海仁达普惠金融发展研究基金会理事长，兰州银行股份有限公司独立董事、江苏泰兴农村商业银行股份有限公司独立董事。2021年5月至今，担任上海国际金融中心研究院荣誉院长。2020年6月起，担任本公司独立董事。

寇宗来先生，独立董事。复旦大学经济学博士。自2003年2月起就职于复旦大学经济学院，先后任讲师、副教授之职。2012年12月至今，任复旦大学经济学院教授、副院长。2023年10月至今，任复旦大学创新与数字经济研究院执行院长，并兼任中国信息经济学会副理事长。2025年3月起，担任本公司独立董事。

王少飞先生，独立董事。上海财经大学经济学博士。自1999年8月参加工作，曾任上海市东湖(集团)公司科员、上海财经大学会计学院博士后。2010年6

月起至今任上海财经大学商学院教师、会计学副研究员，主要从事会计学的教学与研究。王少飞先生现兼任上海合合信息科技股份有限公司、青岛农村商业银行股份有限公司、上海联影医疗科技股份有限公司、国动网络通信集团股份有限公司独立董事，及宝武资源有限公司与宝钢资源（国际）有限公司外部董事之职。2025年3月起，担任本公司独立董事。

（二）公司总经理及其他高级管理人员

张弛先生，董事，总经理。英国兰卡斯特大学金融学硕士。曾在中国建设银行股份有限公司和华安基金管理有限公司就职。后在光大保德信基金管理有限公司担任副总经理兼首席市场总监；在泰康资产管理有限责任公司担任副总经理、首席产品官、董事总经理及执行委员会成员等职务；在贝莱德投资管理（上海）有限公司担任董事总经理职务；在贝莱德基金管理有限公司担任代理董事长、董事、总经理、法定代表人等职务。2024年7月起，担任本公司董事、总经理之职。

喻庆先生，副总经理兼财务负责人。中国政法大学经济法及法务会计专业硕士、中国人民大学应用金融学硕士。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007年8月加盟本公司，担任公司督察长。2026年3月起，担任公司副总经理兼财务负责人，兼任上海浦银安盛资产管理有限公司董事。

汪献华先生，副总经理。上海社会科学院政治经济学博士，高级经济师。曾任安徽经济管理干部学院经济管理系教师；大通证券资产管理部固定收益投资经理；兴业银行资金营运中心高级副理；上海浦东发展银行货币市场及固定收益部总经理；交银康联保险人寿有限公司投资部总经理；上海浦东发展银行金融市场部副总经理。2018年5月30日起，担任本公司副总经理。2019年2月至2020年3月，兼任公司固定收益投资部总监。

陈阳先生，副总经理。北京大学工商管理学硕士。曾在中关村证券（现为国投证券）任理财规划总监、国联安基金管理公司任渠道部北方区总经理、诺安基金管理有限公司北京分公司总经理助理、市场部总监兼南部、东北部营销中心总

经理。现任无锡金投浦银投资管理有限公司董事。2013 年 12 月加入上海浦银安盛资产管理有限公司历任副总经理、总经理、执行董事。2021 年 12 月加盟本公司，2022 年 2 月起担任公司副总经理，2022 年 7 月至 2026 年 1 月兼任上海分公司负责人，2024 年 7 月起兼任深圳分公司负责人。

顾佳女士，督察长。华东政法大学法律专业硕士。2006 年 7 月至 2007 年 9 月在长信基金管理有限公司监察稽核部工作。2007 年 10 月加盟本公司，历任监察稽核部业务经理、监察部经理、合规风控部总经理、公司总经理助理、公司副总经理兼财务负责人。2026 年 3 月起，担任本公司督察长。

赵婷女士，副总经理。厦门大学应用经济学（投资学）博士。曾任厦门银监局、上海银监局科级干部。2014 年 11 月进入上海浦发银行总行工作，历任总行资产管理部投资组合处、固收及专户处处级干部，总行金融市场部贵金属交易处处长，总行金融市场部副总经理等职务。2025 年 3 月起，担任本公司副总经理。

黄俊麟先生，首席信息官。大连海事大学计算机科学与技术专业学士。2003 年 7 月至 2014 年 2 月期间，历任大连联创联合科技有限公司程序员、广达电脑股份有限公司工程师、TNT 中国有限公司 IT 基础设施专员及 DSV 中国有限公司信息技术部负责人。2014 年 2 月至 2020 年 10 月就职于汇添富基金管理股份有限公司，任信息技术部高级 IT 经理。2020 年 10 月加盟本公司，历任信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理（主持工作）、信息技术部总经理。2026 年 2 月起，担任公司首席信息官兼信息技术部总经理。

（三）本基金基金经理

宋施怡女士，中国人民大学金融专业硕士。2013 年 7 月至 2023 年 9 月就职于上海申银万国证券研究所金融工程部，历任助理分析师、分析师、高级分析师、资深高级分析师等职务。2023 年 10 月加盟本公司，现任指数与量化投资部基金经理。2024 年 3 月起担任浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起担任浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 12 月起担任浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银北证 50 成份指数型发起式

证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起担任浦银增长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月起担任浦银上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（四）公募基金投资决策委员会成员

1、公募基金权益投资决策委员会

张弛先生，本公司总经理，董事。

赵婷女士，本公司副总经理。

孙晨进先生，本公司指数与量化投资部总监，基金经理。

张川先生，本公司多元资产配置部总监助理，基金经理。

俞瑾女士，本公司国际业务部副总监，基金经理。

2、公募基金固定收益投资决策委员会

张弛先生，本公司总经理，董事。

汪献华先生，本公司副总经理。

李羿先生，本公司首席固收投资官，基金经理。

曹治国先生，本公司固定收益投资部总监，基金经理。

涂妍妍女士，本公司信用研究部总监。

（五）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（一）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；

（二）办理基金备案手续；

（三）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；

（四）计算并公告基金净值信息，确定各类别基金份额申购、赎回价格；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制基金定期报告；

（七）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；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（九）按规定召集基金份额持有人大会；

（十）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；

（十一）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；

（十二）中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

（一）本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

（二）本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

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、不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；

3、利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

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、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

（三）本基金管理人承诺加强员工管理和培训，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、违反法律法规、《基金合同》或《托管协议》；

3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

6、玩忽职守、滥用职权；

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、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；

9、贬损同行，以抬高自己；

10、以不正当手段谋求业务发展；

11、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

13、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

3、不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；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

（一）内部控制概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，由其董事会、管理层、各部门及分支机构和全体员工建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施的过程，旨在为实现基金管理人经营目标、财务报告和管理信息的真实准确和完整、

经营效率和效果、投资组合和基金管理人资产的安全完整、守法合规等提供合理的保证。内部控制体系是公司内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度的总称。

基金管理人的内部控制要达到的总体目标是：

1、保证基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规、行业监管规则及公司内部规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；

2、防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

3、确保基金、基金管理人财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

（二）内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通和内部监督。

1、内部环境

内部环境是基金管理人实施内部控制的基础，它决定了基金管理人的内部控制基调，并影响着基金管理人内部员工的内控意识。为此，基金管理人从两方面入手营造一个好的控制环境。首先，从“硬控制”来看，本基金管理人遵循健全的法人治理结构原则，设置了职责明确、相互制约的组织结构，各部门有明确的岗位设置和授权分工，操作相互独立。其次，基金管理人更注重“软控制”，基金管理人的管理层牢固树立内部控制和风险管理优先的理念和实行科学高效的运行方式，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，加强全体员工道德规范和自身素质建设，使风险意识贯穿到基金管理人的各个部门、各个岗位和各个环节。

2、风险评估

本基金管理人的风险评估和管理分三个层次进行：第一层次为公司各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险管理委员会、风险管理部、法律合规部的风险管理；第三层次为公司董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、审计委员会、合规风控委员会、督察长和审计部。

3、控制活动

本基金管理人制定了各项规章制度，通过各种预防性的、检查性的和修正性的控制措施，把控制活动贯穿于基金管理人经营活动的始终，尤其是强调对于基金资产与基金管理人的资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；严格岗位分离，明确划分各岗位职责，明确授权控制；对重要业务部门和岗位进行了适当的物理隔离；制订应急应变措施，危机处理机制和程序。

4、信息与沟通

本基金管理人建立清晰、有效的垂直报告制度和平行通报制度，以确保识别、收集和交流有关运营活动的关键指标，使员工了解各自的工作职责和基金管理人的各项规章制度，并建立与客户和第三方的合理交流机制。

5、内部监督

督察长、审计部、法律合规部负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制以及公司内部控制制度的执行情况，保证内部控制制度的落实。各部门必须切实协助经营管理层对日常业务管理活动和各类风险的总体控制，并协助解决所出现的相关问题。按照基金管理人内部控制体系的设置，实现一线业务岗位、各部门及其子部门根据职责与授权范围的自控与互控，确保实现内部监控活动的全方位、多层次的展开。

（三）内部控制原则

1、全面性原则：内部控制在层次上应当涵盖董事会、管理层、各部门及分支机构和全体员工，在内容上应该覆盖公司的各项业务和管理活动，在流程上应当渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2、有效性原则：通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行；

3、重要性原则：在内部控制体系中使用适当的风险评估手段并应当在兼顾全面的基础上突出重点，针对重要业务与事项及评估为高风险的领域与环节采取更为严格的控制措施；

4、制衡性原则：部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡和监督，同时兼顾运营效率。履行内部控制监督检查职责的部门应当具有独立性。各投资组合

资产、基金管理人固有资产和其他资产的运作应当分离；

5、适应性原则：内部控制应当与经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，并随着情况的变化及时加以调整；

6、成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，争取以合理的控制成本达到更优的内部控制效果。

（四）内部控制机制

内部控制机制是指基金管理人的组织结构及其相互之间的制约关系。内部控制机制是内部控制的重要组成，健全、合理的内部控制机制是基金管理人经营活动得以正常开展的重要保证。

从功能上划分，基金管理人的内部控制机制可分为“决策系统”、“执行系统”、“监督系统”三个方面。监督系统在各个内部控制层次上对决策系统和执行系统实施监督。

决策系统是指在基金管理人经营管理过程中拥有决策权力的有关机构及其之间的关系。执行系统是指具体负责将基金管理人决策系统的各项决议付诸实现的一些职能部门。

执行系统在总经理执行委员会的直接领导下，承担了公司日常经营管理、基金投资运作和内部管理工作。

监督系统对基金管理人的决策系统、执行系统进行全程、动态的监控，监督的对象覆盖基金管理人经营管理的全部内容。基金管理人的监督系统从监督内容划分，大致分为三个层次：

1、审计委员会——对董事、高管人员的行为及董事会的决策等进行监督；

2、董事会专门委员会及督察长——根据董事会的授权对基金管理人的经营活动等进行监督和评价；

3、审计部——根据总经理及督察长的安排，对基金管理人的经营活动及各职能部门等进行内部监督和检查。

（五）内部控制层次

在内部控制机制的基础之上，公司建立了三层次的内部控制体系。

第一层次为公司各业务部门的自我管理和检查。所有员工必须经过岗位培训，

签署自律承诺书，保证遵守国家的法律法规以及基金管理人的各项管理制度；保证良好的职业操守；保证诚实信用、勤勉尽责等。基金管理人的各部门主管在权限范围之内，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定、基金管理人的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任。

第二层次为公司管理层及其下设的风险管理委员会、风险管理部及法律合规部的控制及管理。公司管理层、风险管理委员会、风险管理部及法律合规部采取各种控制措施，管理和支持各个部门和各项业务进行，以确保基金管理人运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

第三层次为公司董事会、及下设的审计委员会及合规风控委员会、督察长和审计部的监督控制。所有员工应自觉接受并配合董事会、及下设的审计委员会及合规风控委员会、督察长和审计部对各项业务和工作行为的检查监督。合理的风险分析和管理建议应予采纳，基金管理人规定的风险控制措施必须坚决执行。董事会对内部控制负最终责任。

（六）内部控制制度

内部控制制度是指规范公司内部控制的一系列规章制度和业务规则、流程，是公司内部控制的重要组成部分。公司为执行内部控制措施以实现内部控制目标，在法律法规和行业监管规章有关规定的基础上，制定了一套公司内部控制制度。公司内部控制制度从其制定的目的和适用范围分为四个层次：

1、《公司章程》、股东会议事规则、董事会议事规则。《公司章程》是具有法律约束力的纲领性文件，是规范公司的组织与行为、公司与股东之间以及股东相互之间权利和义务关系的基础，是确定公司与其他相关利益主体之间关系基本规则以及保证这些规则得到具体执行的依据；

2、内部控制大纲。内部控制大纲是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。内部控制大纲应经董事会的审阅与批准。

3、基本管理制度。基本管理制度主要根据相关法律法规，从规范公司管理和业务开展的角度出发，以业务为中心，就业务开展的目标、原则、过程、风险

控制等方面作出规定，以指导各项业务的顺利开展。公司基本管理制度应经董事会的审阅与批准。

4、业务管理规定及部门规章等。业务管理规定及部门规章等主要在执行内部控制大纲和基本管理制度的基础上，以业务管理环节和部门管理为中心，对业务操作管理方法、具体流程及部门管理方法及岗位职责等作出明确和细化的规定，以规范部门内部和部门与部门之间、具体业务操作环节等工作的开展。业务管理规定及部门规章等应经公司执行委员会的审阅与批准。

（七）基金管理人关于内部控制的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人概况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张金良

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟陆佰壹拾陆亿零叁拾捌万壹仟肆佰伍拾玖元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：王小飞

联系电话：(021)6063 7103

（二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金业务处、证券保险业务处、理财信托业务处、全球业务处、养老金业务处、新兴业务处、客户服务与业务协同处、运营管理处、跨境与外包管理处、托管应用系统支持处、内控合规处等 12 个职能处室，在北京、上海、合肥设有托管运营中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目

前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2025 年末，中国建设银行已托管 1,536 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并先后荣获《亚洲银行家》颁发的 2017 年度“最佳托管系统实施奖”、2019 年度“中国年度托管业务科技实施奖”、2021 年度“中国最佳数字化资产托管银行”、以及 2020 年度、2022 年度“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。2023 年度，荣获《中国基金报》“公募基金 25 年最佳基金托管银行”奖项。2024 年度，荣获《中国基金报》“优秀 ETF 托管人”、《中国证券报》“ETF 金牛生态圈卓越托管机构（银行）”、《环球金融》“中国最佳次托管人”奖项。2025 年度，荣获《中国基金报》“指数生态圈英华奖”、《环球金融》“中国最佳次托管人”等奖项。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和中国建设银行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

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

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集

中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

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

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

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

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

1、浦银基金管理有限公司上海直销中心

住所：中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座

电话：（021）23212899

传真：（021）23212890

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

联系人：徐薇

网址：www.spdbfunds.com

2、浦银基金管理有限公司电子直销

（二）其他销售机构

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行信息披露义务。

二、登记机构

名称：浦银基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

法定代表人：张健

联系人：孙赵辉

电话：（021）23212909

传真：（021）23212980

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

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：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼

合伙人：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、欧梦溦

五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

第六部分 基金的募集

本基金经中国证监会证监许可【2025】1264 号文注册募集，于 2025 年 7 月 10 日至 2025 年 7 月 23 日向社会公开募集。

本基金募集有效认购户数为 1,614 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本息合计募集基金份额总额 A 类基金份额为 57,033,444.81 份，C 类基金份额为 30,427,581.92 份，共计 87,461,026.73 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中基金管理人的基金从业人员认购持有的基金份额总额为 116,325.93 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.13%。

第七部分 基金合同的生效

本基金于 2025 年 7 月 25 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

《基金合同》生效之日起满三年后的对应日（指自然日），若基金资产规模低于 2 亿元，《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限。如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

本基金已于 2025 年 8 月 4 日开放了申购和赎回业务。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在本招募说明书或基金管理人网站中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理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、北京证券交易所等相关交易场所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、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

基金合同生效后，基金管理人在满足监管要求的情况下，根据本基金运作的需要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相关公告中规定。

基金合同生效后，基金管理人在满足监管要求的情况下，根据本基金运作的需要决定本基金开始办理赎回的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日相应类别基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，但申请经登记机构受理的不得撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、基金管理人有权决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告；

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人在规定时间内全额交付申购款项，申购成立，本基金登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成立，申购款项本金将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立，本基金登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。基金管理人、基金托管人和销售

机构等不承担由此顺延造成的损失或不利后果。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人通过其他销售机构和电子直销渠道首次申购单笔最低金额为人民币 0.1 元（含申购费），追加申购单笔最低金额为人民币 0.1 元（含申购费）；投资人通过直销机构（柜台方式）首次申购单笔最低金额为人民币 10,000 元（含申购费），追加申购单笔最低金额为人民币 1,000 元（含申购费）。

2、本基金不设单笔赎回份额下限，基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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、单日或单笔申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人有权决定本基金的总规模限额或单日净申购比例上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或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。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额、单个投资人累计持有的基金份额上限、单日或单笔申购金额上限、本基金的总规模限额或单日净申购比例上限等。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、申购费用和赎回费用

1、申购费用

本基金根据收费方式的不同分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。投资人可以多次申购本基金，A 类基金份额的申购费用按每笔 A 类基金份额的申购申请单独计算。

本基金 A 类和 C 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	A类基金份额申购费率	C类基金份额申购费率
M＜100万元	1.0%	0
100万元≤M＜300万元	0.80%	
300万元≤M＜500万元	0.60%	
M≥500万元	按笔收取，每笔1000元	

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用

基金份额的赎回费率随持有时间的增加而递减。

本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期间（N）	A类/C类基金份额赎回费率
N＜7日	1.5%
N≥7日	0

本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费用由赎回该类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，持续持有期少于 7 日的，赎回费应全额归入基金财产。

3、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，并

最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金销售服务费率或免除上述费用，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

七、申购份额与赎回金额的计算

（一）本基金申购份额的计算

1、A 类基金份额

申购本基金 A 类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

当 A 类基金份额的申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日（T 日）A 类基金份额净值

当 A 类基金份额的申购费用为固定金额时：

申购费用＝固定金额

净申购金额＝申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/申购当日（T 日）A 类基金份额净值

2、C 类基金份额

如果投资人选择申购 C 类基金份额，则申购份数的计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日（T 日）C 类基金份额净值

3、上述申购费用以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

4、上述申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 1.0%，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额＝50,000/（1＋1.0%）＝49,504.95 元

申购费用＝50,000－49,504.95＝495.05 元

申购份额＝49,504.95/1.0500＝47,147.57 份

即：如果投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 1.0%，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则该投资人可获得申购份额为 47,147.57 份。

例：某投资人投资 5 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额＝50,000/1.0500＝47,619.05 份

即：如果投资人投资 5 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则该投资人可获得申购份额为 47,619.05 份。

（二）赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日各类别基金份额的基金份额净值为基准进行计算。

基金份额持有人在赎回基金份额时缴纳赎回费，赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，赎回金额的计算方式如下：

赎回总额 = 赎回份额 × T 日该类别基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 对应类别基金份额赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 － 赎回费用

上述计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回 1 万份本基金的任一类基金份额，持有时间为 3 日，对应

的赎回费率为 1.5%,假设赎回当日该类基金份额净值是 1.1200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1200=11,200.00 元

赎回费用=11,200.00×1.50%=168.00 元

赎回金额=11,200.00-168.00=11,032.00 元

即：投资人赎回 1 万份本基金的任一类基金份额，持有时间为 3 日，对应的赎回费率为 1.5%,假设赎回当日该类基金份额净值是 1.1200 元，则其可得到的赎回金额为 11,032.00 元。

（三）本基金基金份额净值的计算

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类别基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的各类别基金份额净值计算公式如下：

T 日 A 类基金份额净值＝T 日闭市后 A 类基金份额的基金资产净值/T 日 A 类基金份额的余额数量

T 日 C 类基金份额净值＝T 日闭市后 C 类基金份额的基金资产净值/T 日 C 类基金份额的余额数量

本基金各类别基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类别基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。为避免基金份额持有人利益因基金份额净值的小数点保留精度受到不利影响，基金管理人可提高各类别基金份额净值的精度。

（四）申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日的该类别基金份额净值为基准计算，采用四舍五入的方法保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（五）赎回金额、余额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类别基金份额净值

并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、申购和赎回的登记

（一）投资人申购基金成功后，登记机构在 T＋1 日为投资人增加权益并办理登记手续。

（二）基金份额持有人赎回基金成功后，登记机构在 T＋1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

（三）基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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办理申购业务。

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

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常工作运行。

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

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

9、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者累计持有的基金份额上限、单日或单笔申购金额上限的。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定进行公告。当发生上述第 8、9 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人也有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项或延期办理的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项或延期办理：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项或延期办理时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。

在本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的情形下，基金管理人可以采取如下措施：对于该单个基金份额持有人当日超过 10%的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理，即转到下一开放日一并处理；对于该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。当基金管理人认为有能力支付时，按正常赎回程序执行。当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，按单个账户赎回申请量占合并办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。

基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在规定媒介上进行公告。

对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开

放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的相应类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者本招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并依据《信息披露办法》的相关规定在规定媒介上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应依据相关规定在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金份额的转让

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

十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规或国家有权机构要求的其它非交易过户，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人，并按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

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

十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

如果出现基金管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

十七、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的《招募说明书》中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十八、基金份额的冻结和解冻

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

十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“第十

六部分 侧袋机制”或相关公告。

二十、其他业务

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响并履行适当程序的条件下，基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务。证券/期货交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则另有规定的，从其规定。

二十一、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响并履行适当程序的前提下，基金管理人可以依据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务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。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板、北京证券交易所发行上市的其他股票及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

（一）股票投资策略

本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建

投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

本基金通过严格的投资流程和量化风险管理手段，在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

如出现股票停牌、股票流动性较差或其他影响指数复制的因素，使基金管理人无法依指数权重购买成份股时，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。

如果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基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

（二）存托凭证投资策略

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

（三）债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

（四）可转换债券与可交换债券投资策略

本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑债券的久期、票面利率、信用风险等债券因素以及期权价值，力求选择被市场低估的品种。一方面，本基金将对可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、

NAV 等）相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。同时可转债可以按照约定的价格转换为股票。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，把握套利机会，以增强本基金的收益。

（五）股指期货交易策略

本基金的股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对股票市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（六）国债期货交易策略

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（七）股票期权投资策略

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征。

（八）资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

（九）参与融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资及转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资及转融通证券出借业务。参与融资及转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融

券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，提高基金的投资收益。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

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）本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

（9）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。

基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（10）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；

（11）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（14）本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1）出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2）参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的50%；

3）最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

4）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；

5）因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（15）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）本基金若参与国债期货、股指期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

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

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

8）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；

9）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和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；

（17）本基金参与股票期权交易后，则需遵守下列投资比例限制：

1）基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；

2）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3）未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按

照行权价乘以合约乘数计算；

（18）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；

（19）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（20）法律法规和基金合同规定的其他限制。

除上述第（2）、（9）、（12）、（13）、（14）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行法定程序后，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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行法定程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

3、关联交易原则

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。

五、标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为北证 50 成份指数及其未来可能发生的变更。

本基金业绩比较基准为：北证 50 成份指数收益率*95%＋银行活期存款利率（税后）*5%

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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自相关情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

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

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其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。

本基金为指数型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金投资北京证券交易所股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规

则等差异带来的特有风险。

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权利或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”的规定。

九、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2026 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	117,574,883.48	86.51
	其中：股票	117,574,883.48	86.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,660,549.62	12.99
8	其他资产	679,887.82	0.50
9	合计	135,915,320.92	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	994,294.40	0.80
C	制造业	98,738,059.91	79.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,951,817.22	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,039,458.28	11.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	1,851,253.67	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	117,574,883.48	94.30

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	920185	贝特瑞	302,884	8,804,837.88	7.06
2	920982	锦波生物	41,221	6,185,211.05	4.96
3	920522	纳科诺尔	98,268	4,656,920.52	3.73
4	920493	并行科技	32,085	4,566,658.05	3.66
5	920599	同力股份	248,535	4,473,630.00	3.59
6	920368	连城数控	126,157	4,271,676.02	3.43
7	920047	诺思兰德	171,942	4,160,996.40	3.34
8	920116	星图测控	42,927	3,859,137.30	3.10
9	920808	曙光数创	53,735	3,718,462.00	2.98
10	920077	吉林碳谷	210,525	3,524,188.50	2.83

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

（十一）投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	679,887.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	679,887.82

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

十、基金业绩

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

（一）浦银北证 50 成份指数 A 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2025 年 7 月 25 日至 2025 年 12 月 31 日	-0.07%	1.67%	-0.64%	1.70%	0.57%	-0.03%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 31 日	-13.01%	1.82%	-12.67%	1.80%	-0.34%	0.02%
2025 年 7 月 25 日至 2026 年 3 月 31 日	-13.07%	1.72%	-13.23%	1.73%	0.16%	-0.01%

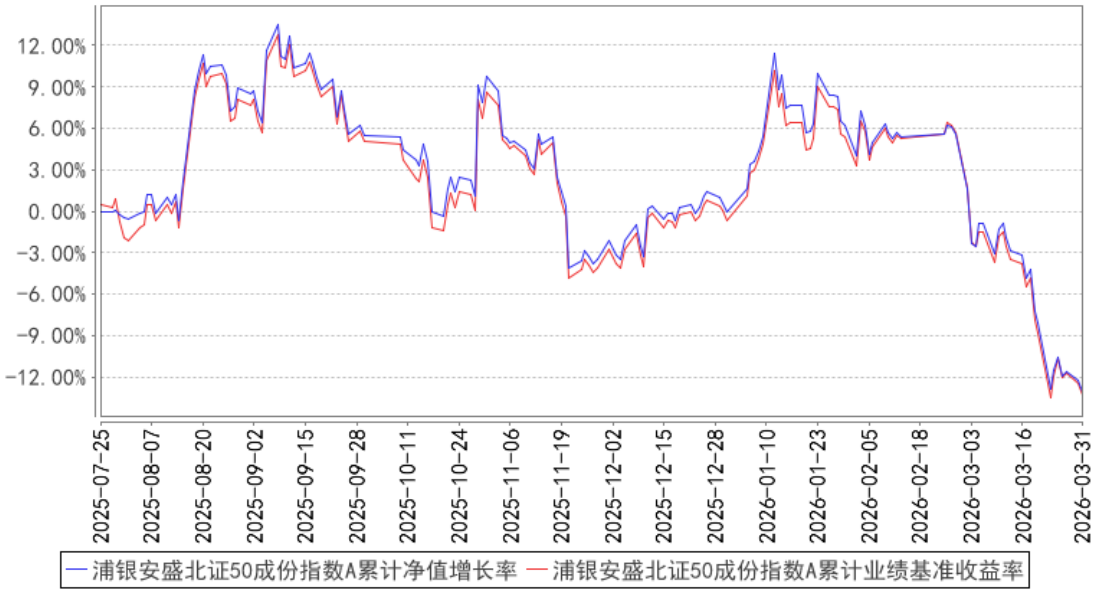
浦银北证 50 成份指数 C 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2025 年 7 月 25 日至 2025 年 12 月 31 日	-0.18%	1.67%	-0.64%	1.70%	0.46%	-0.03%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 31 日	-13.07%	1.82%	-12.67%	1.80%	-0.40%	0.02%

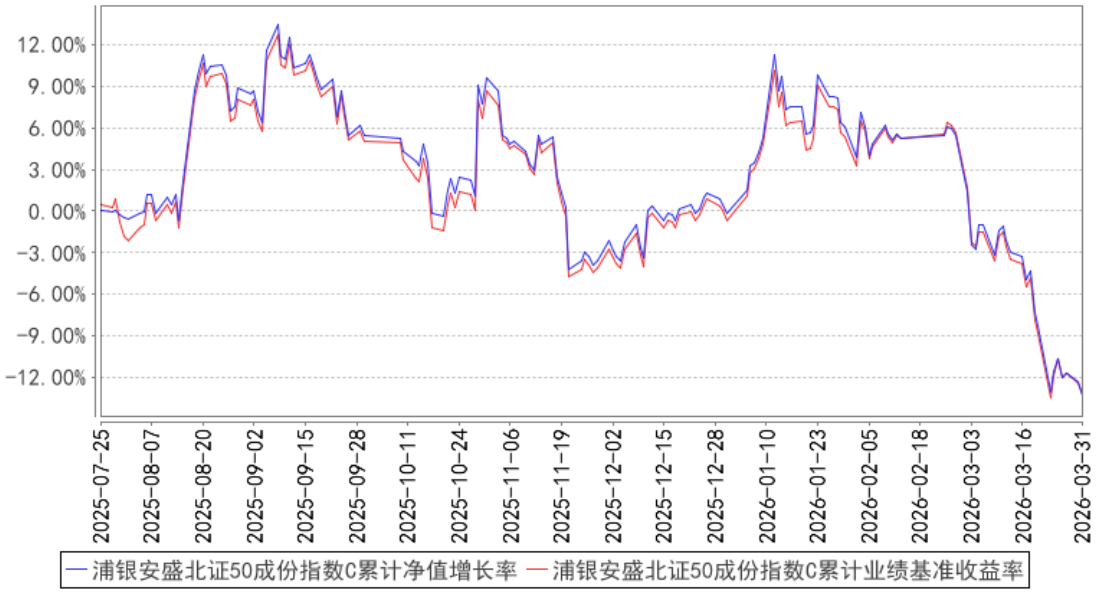
2025 年 7 月 25 日至 2026 年 3 月 31 日	-13.23%	1.72%	-13.23%	1.73%	0.00%	-0.01%

（二）自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛北证50成份指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛北证50成份指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、证券经纪机构、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、证券经纪机构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、证券经纪机构、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。

第十一部分 基金资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、衍生工具、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。

三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、监管部门有关规定。

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

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

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

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

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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。

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。

2、固定收益品种的估值

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

（2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；

（3）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券按照估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券按照估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；

（4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，如无第三方估值基准服务机构提供的估值价格，则采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值。

4、流通受限股票的估值方法

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

5、同一证券同时在两个或者两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

7、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，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。

本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

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、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、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

10、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。

11、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

五、估值程序

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

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及各类别基金份额净值，并按规定公告基金净值信息。

2、基金管理人应在每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类别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。当某一类别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，视为该类别基金份额净值错误。

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、或证券经纪机构、或期货公司、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数

据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基

金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差达到该类别基金份额净值的 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；错误偏差达到该类别基金份额净值的 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。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，基金管理人与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重新协商确定处理原则。

七、暂停估值的情形

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

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

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，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它情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和各类别基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类别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，由基金管理人对基金净值予以公布。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、期货经纪机构、证券经纪

机构、登记机构、指数编制机构、存款银行或第三方估值基准服务机构等第三方机构发送的数据错误、遗漏，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，但未能发现错误或因前述原因未能避免或更正错误的，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。

十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

第十二部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、账户开户费用和账户维护费；

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%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 4－10 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：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、标的指数许可使用费，指数许可使用费由基金管理人支付；

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、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”或相关公告的规定。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。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。

第十三部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除资产减值和相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式；

4、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，并于调整实施日前在规定媒介公告。

四、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。

五、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，按《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

六、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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”的规定。

第十四部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

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托管协议约定方式确认。

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按《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

第十五部分 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，无需经基金份额持有人大会审议。

二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、基金份额发售公告

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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

《基金合同》生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，基金招募说明书、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招募说明书和基金产品资料概要。

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。

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

（三）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类别基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

（四）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

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

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于规定网站上，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。

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

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

（六）临时报告

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

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；

11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到

重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、某一类别基金份额净值计价错误达该类别基金份额净值百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金发生巨额赎回并延期办理；

20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、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；

23、本基金推出新业务或服务；

24、增加、取消或调整本基金份额类别设置；

25、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

26、本基金变更标的指数；

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或基金合同规定的其他事项。

（七）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。

（八）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。

（九）发起资金认购份额报告

基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求，在基金合同生效公

告、定期报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

（十）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。

（十一）股指期货交易的信息披露

若本基金参与了股指期货交易，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交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。

（十二）国债期货交易的信息披露

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

（十三）股票期权投资的信息披露

若本基金参与了股票期权交易，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）等文件中披露股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定投资政策和投资目标。

（十四）投资资产支持证券的信息披露

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

（十五）投资非公开发行股票的信息披露

基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规

定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

（十六）参与融资及转融通证券出借业务的信息披露

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

（十七）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。

（十八）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”的规定。

（十九）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类别基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的

基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，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。

七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于其住所，以供社会公众查阅、复制。

八、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交易市场、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、出现《基金合同》约定的暂停估值的情形；

4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

第十六部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件和实施程序

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及基金管理人所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金服务机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额。当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

（一）基金份额的申购与赎回

1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

3、基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。

4、侧袋机制实施期间，相关证券交易所和/或中国证券登记结算有限责任公司对本基金基金份额的申购、赎回及份额登记另有规定的，从其最新规定。具体安排请见基金管理人届时发布的相关公告。

（二）基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

侧袋机制实施期间，基金管理人、基金服务机构在计算基金业绩相关指标时仅考虑主袋账户资产，分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少在计算基金业绩相关指标时按投资损失处理。基金管理人、基金服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

（三）基金的费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见届时发布的相关公告。

因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

（四）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

（五）基金的信息披露

1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的各类别基金份额净值和基金份额累计净值。

2、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当按照法律法规的规定在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露。会计师事务所对

基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露，执行适当程序并发表审计意见。

3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

（六）特定资产的处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都将及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人应注销侧袋账户。

（七）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规针对侧袋机制的内容有进一步规定的，或相关证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司新增相关业务规则且适用于本基金的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十七部分 风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。

本基金为股票型基金，其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。本基金为指数型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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

投资人应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或其他销售机构申购和赎回基金，销售机构名单详见基金份额发售公告以及基金管理人网站。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；本基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他销售机构销售，基金管理人与其他销售机构都不能保证其收益或本金安全。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

一、市场风险

证券/期货市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券/期货市场的收益水平也呈周期性变化，从而引起债券和股票价格波动，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券/期货市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

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

6、购买力风险。基金投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

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时的收益率的影响。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，将获得较以前低的收益率。

二、流动性风险

在本基金的开放日，基金管理人有义务接受投资者的申购和赎回。基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。基金管理人并不保证完全避免此类风险的发生但本基金将通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，努力去克服流动性风险。

1、基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分　基金份额的申购与赎回”和本招募

说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券/期货交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所。本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证），投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%。综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中，但不排除在特定市场环境下标的指数成份股出现流动性较差的情况。基金管理人将根据市场情况，基于对个股的基本面研究和投资经验，对投资组合进行优化，保持投资组合的流动性，降低投资组合的流动性风险。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回或暂停赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、侧袋机制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，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并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、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。本基金实施备用的流动性风险管理工具对投资者的潜在影响包括但不限于：

（1）延期办理巨额赎回申请

在此情形下，投资者的全部或部分赎回申请可能将被延期办理，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值发生变化。

（2）暂停接受赎回申请

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

（3）延缓支付赎回款项

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

（4）收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。在此情形下，投资人面临较高的赎回费。

（5）暂停基金估值

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，基金管理人可采取暂停接受基金申购赎回申请的措施或延缓支付赎回款项。

（6）摆动定价

本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。在此情形下，投资人申购或赎回基金份额时可能面临高于预期的基金份额净值波动风险。

（7）侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露各类别基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户的基金净值信息，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

三、管理风险

1、在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、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因素的变化也会影响基金收益水平。

四、操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权违规交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在基金的后台运作中，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甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券/期货交易所和证券登记结算机构等。

五、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》有关规定而产生的风险。

六、本基金特有风险

1、指数基金投资风险

（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

（2）标的指数波动的风险

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

（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与跟踪基准之间产生偏离：

1）标的指数调整成份股或变更编制方法；

2）标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；

3）由于成份股摘牌或流动性差等因素带来的偏差；

4）基金现金资产拖累所产生的跟踪误差；

5）基金投资过程中的证券交易成本，以及管理费和托管费所产生的跟踪误差；

6）基金在指数化投资过程中，跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，均可能对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度；

7）基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差；

8）其他因素带来的偏差。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（5）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的

风险与成本。

（6）指数编制机构停止服务的风险

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

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

（7）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时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、本基金可进行股指期货和国债期货交易，股指期货和国债期货作为金融衍生品，具备一些特有的风险点。进行股指期货和国债期货交易所面临的主要风险是市场风险、流动性风险和基差风险。

3、投资股票期权的风险

本基金可参与股票期权交易，股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

4、非公开发行股票等流通受限证券投资风险

本基金可投资非公开发行股票等流通受限证券，因此，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格下跌的风险。

5、投资资产支持证券的风险

本基金可能投资于资产支持证券。本基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

6、投资北京证券交易所股票的风险

（1）市场风险

北京证券交易所上市企业主要为创新型中小企业，体现“更早、更小、更新”的特点，但其高成长性与高风险并存。企业因多处于成长期，市值规模偏小，对核心技术人员和供应商的依赖性相对更高，企业的客户集中度高、财务稳定性较低，应对外部冲击能力相对较弱，企业的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

（2）股价波动风险

首先，北京证券交易所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。

其次，北京证券交易的制度规则与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，可能导致在此交易的股票股价波动较大。北京证券交易所的新股上市首日不设涨跌幅限制，日常交易涨跌幅限制为 30%（较主板、创业板和科创板更宽松）。所以北京证券交易所上市股票的个股波动幅度较其他股票加大，股价波动风险随之上升。

（3）流动性风险

北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（4）信用风险

北京证券交易所自成立起即实行注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，北京证券交易所个股存在更高的退市风险。北京证券

交易所股票可能因触及退市情形被终止上市。股票退市可能会给本基金带来不利影响。

（5）系统性风险

北京证券交易所上市企业均为创新型中小企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以北京证券交易所个股相关性相对较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

（6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对北京证券交易所上市企业带来较大影响，国际经济形势变化对“专精特新”企业和上市个股也会带来政策影响。

7、投资科创板股票的风险

（1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

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

（2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（3）信用风险

科创板实施注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

（4）集中度风险

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

（5）系统性风险

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

（6）政策风险

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

8、存托凭证投资风险

基金资产可投资于存托凭证，会面临与境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于企业业务持续能力和盈利能力等经营风险；存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

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

9、本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：

（1）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

（2）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

（3）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。

10、本基金可参与融资业务，面临的风险包括但不限于：

（1）投资风险：在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。

（2）合规风险：由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阀值等。

（3）其他风险：如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

11、采用证券经纪商交易结算模式的风险

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易，并由选定的证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

12、基金合同自动终止的风险

本基金为发起式基金，在基金募集时，发起资金提供方将运用发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时，发起资金提供方有可能赎回认购的本基金份额。自基金合同生效之日起满三年后的对应日（指自然日），如果本基金的资产净值低于 2 亿元，基金合同将自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限。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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

13、基金运作方式、投资模式变更的风险

若未来基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则

基金管理人在履行适当程序后，有权将本基金转换为该 ETF 基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。转换实施前基金管理人需及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

若未来北京证券交易所与中国证券登记结算有限责任公司推出上市开放式基金（LOF）及其清算交收与登记模式，并开通上市开放式基金（LOF）在北京证券交易所申购、赎回及上市交易，基金管理人有权将本基金调整为上市开放式基金（LOF），并相应调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式；或新增基金份额及调整其清算交收与登记模式、申购、赎回方式并上市交易。基金管理人需相应修改《基金合同》，变更实施前基金管理人需及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

投资者还有可能面临运作方式、投资模式变更、《基金合同》相应修改的风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

八、其他风险

1、在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

6、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；

7、其他意外导致的风险。

第十八部分 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。对于法律法规规定或基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

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，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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、《基金合同》生效之日起满三年后的对应日（指自然日），若基金资产规模低于 2 亿元的；如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行；

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

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、交纳基金所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的各类别基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

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

八、基金合并方案

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

第十九部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、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。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别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、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用，并主动查询交易申请的确认情况，并妥善行使合法权利；

（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）提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实、准确、完整；

（10）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

（11）发起资金提供方持有使用发起资金认购的基金份额的期限自《基金合同》生效日起不少于 3 年；

（12）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、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、赎回与转换申请；

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

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资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、转托管、定期定额投资、非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露，但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求提供，或因审计、法律等向外部专业顾问提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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、《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反法律法规、《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，将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金托管人的权利、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、《基金合同》和《托管协议》的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》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》、《托管协议》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提供，或因审计、法律等向外部专业顾问提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类别基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

（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》、《托管协议》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》、《托管协议》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，保存年限不低于法律法规规定的最低年限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规、《基金合同》及《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，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立日常机构。

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、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，法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的无需召开基金份额持有人大会的除外：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费；

（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）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》约定的范围内且对现有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，无需召开基金份额持有人大会：

（1）调低 C 类基金份额类别的销售服务费率；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）调整本基金的申购费率或变更收费方式；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）停止现有基金份额类别的销售，增加、取消或调整基金份额类别设置，

对基金份额分类办法及规则进行调整；

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

（7）履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

（8）基金管理人、相关证券/期货交易所、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务规则；

（9）按照法律法规和《基金合同》规定无需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式（包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等）、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及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会

议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

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

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

3、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，经会议通知载明，本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话、短信或其他非书面方式向其授权代表进行授权。具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、中国证监会

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。

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

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权均需符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、若参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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；

7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

（十）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、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人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。

（十一）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除资产减值和相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中

已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式；

4、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，并于调整实施日前在规定媒介公告。

（四）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。

（五）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，按《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（六）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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、账户开户费用和账户维护费；

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%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，

如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4－10 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：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或

基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、标的指数许可使用费，指数许可使用费由基金管理人支付；

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）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书或相关公告的规定。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板、北京证券交易所发行上市的其他股票及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

（10）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；

（11）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（14）本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1）出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2）参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；

3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4）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；

5）因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（15）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）本基金若参与国债期货、股指期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

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

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

8）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；

9）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和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；

（17）本基金参与股票期权交易后，则需遵守下列投资比例限制：

1）基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3）未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（18）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；

（19）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（20）法律法规和基金合同规定的其他限制。

除上述第（2）、（9）、（12）、（13）、（14）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行法定程序后，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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行法定程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

3、关联交易原则

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。

（四）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）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。

（二）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类别基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

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

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，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、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或法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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、《基金合同》生效之日起满三年后的对应日（指自然日），若基金资产规模低于 2 亿元的；如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行；

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

（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、交纳基金所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的

各类别基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

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

（八）基金合并方案

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均应当将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和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。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

九、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。

第二十部分 基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：浦银基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

邮政编码：200127

法定代表人：张健

成立时间：2007 年 8 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：120,000 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理，境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

（二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：张金良

成立时间：2004 年 09 月 17 日

批准设立机关及批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复[2004]143 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟陆佰壹拾陆亿零叁拾捌万壹仟肆佰伍拾玖元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式，将拟投资的标的证券库提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，对标的证券库予以更新和调整并及时书面通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板、北京证券交易所发行上市的其他股票及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比

例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

（1）本基金投资于股票资产及存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

（8）本基金管理人管理的且在本基金托管人处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%；

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

（10）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；

（11）本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（13）本基金参与转融通证券出借业务，需遵循下述比例限制：

1）出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2）参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；

3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

4）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；

5）因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（14）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%；

（15）本基金若参与国债期货、股指期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

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

7）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；

8）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和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；

（16）本基金参与股票期权交易后，则需遵守下列投资比例限制：

1）基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2）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；

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

（18）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（19）法律法规和基金合同规定的其他限制。

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

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

开始。

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

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第（九）款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其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。

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

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

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

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

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。若有最新法律法规、监管政策变更规定的，根据最新法律法规、监管政策执行。

2.基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

（1）中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

（2）非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

（3）基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

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

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两日内编制临时报告书，予以公告。

5.相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

（五）基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，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。基金托管人将对基金参与转融通证券出借业务的投资比例进行监督。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类别基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应及时核对并以邮件或书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（八）基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（九）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当及时通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

（十一）当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

基金托管人依照相关法律法规的规定和基金合同的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行监督。侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定、基金合同和招募说明书的约定执行。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类别基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪机构的固有财产。

2. 基金托管人应安全保管基金财产。

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账

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.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

6.对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7.除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在有托管资格的商业银行处开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时，发起资金的认购金额、发起资金提供方及其承诺的持有期限符合《基金法》、《运作办法》、基金合同等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

（三）基金托管资金账户的开立和管理

1.基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开立基金的托管资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托

管人保管和使用。

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

3.基金托管资金账户的开立和管理应符合法律法规和银行业监督管理机构的有关规定。

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

5.基金管理人应于基金清算后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转，在确保后续不再发生款项进出后的 10 个工作日内向基金托管人发出销户申请。

（四）基金证券账户和证券资金账户的开立和管理

1.基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待本基金启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4.基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与基金托管人开立的基金托管资金账户建立第三方存管关系。

交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经纪机构负责，证券资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管资金账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。第

三方存管对应关系一经确定，不得更改，如果必须更改，应由基金管理人发起，经过基金托管人书面确认后，重新建立第三方存管对应关系。基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户、证券资金账户，亦不得使用证券账户或证券资金账户进行本基金业务以外的活动。基金管理人承诺证券资金账户为主资金账户，不开立任何辅助资金账户；不为证券资金账户另行开立托管资金账户以外的其他银行账户。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

5.账户注销时，在遵守中国证券登记结算有限责任公司的相关规定下，由基金管理人和基金托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

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

（五）银行间账户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户和资金结算专户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

（六）其他账户的开立和管理

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

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入法律法规有关规定允许的各类代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人

以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供合同传真件或复印件并加盖公章，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。各类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金份额的基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位（如有）四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及各类别基金份额净值，并按规定公告基金净值信息。

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

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1.估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、衍生工具、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。

2.估值方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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。

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。

（2）固定收益品种的估值

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

2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；

3）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券按照估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券按照估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；

4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，如无第三方估值基准服务机构提供的估值价格，则采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

（3）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值。

（4）流通受限股票的估值方法

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

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

（5）同一证券同时在两个或者两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

（6）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

（7）本基金投资股指期货合约、国债期货合约，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。

本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

（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）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、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

（10）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。

（11）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算

结果对外予以公布。

3.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（10）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、期货经纪机构、证券经纪机构、登记机构、指数编制机构、存款银行或第三方估值基准服务机构等第三方机构发送的数据错误、遗漏，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，但未能发现错误或因前述原因未能避免或更正错误的，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。

（三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当某一类别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，视为该类别基金份额净值错误。

1.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）错误偏差达到该类别基金份额净值的 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；错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

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

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

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

3.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。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，基金管理人与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重新协商确定处理原则。

（四）暂停估值的情形

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

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

3.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，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它情形。

（五）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

（六）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（七）基金账册的建立

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

（八）基金财务报表与报告的编制和复核

1.财务报表与报告的编制

基金财务报表与报告由基金管理人编制，基金托管人复核。

2.报表与报告的复核

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

3.财务报表与报告的编制与复核时间安排

(1)报表与报告的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 2 个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起 3 个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

(2)报表与报告的复核

基金管理人应及时完成报表与报告的编制，将有关报表或报告提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表或报告存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表或报告达成一致，基金管理人按照其编制的报表或报告对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

（九）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基

金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、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，法律法规或监管部门另有规定的除外。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均应当将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。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，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

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

（二）托管协议终止的情形

1.《基金合同》终止；

2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金托管业务；

3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理业

务；

4.发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，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。

6.清算费用

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

7.基金财产清算剩余资产的分配

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

8.基金财产清算的公告

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

9.基金财产清算账册及文件的保存

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

10.基金合并方案

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

第二十一部分 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，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。主要的服务项目如下：

一、资料寄送

1、基金交易对账单

本基金管理人将按照份额持有人的定制情况，提供电子邮件或短信方式对账单。客户可通过浦银基金客户服务热线进行对账单服务定制或更改。

电子邮件对账单经互联网传送，可能因邮件服务器解析等问题无法正常显示原发送内容，也无法完全保证其安全性与及时性。因此浦银基金管理公司不对电子邮件或短信息电子化账单的送达做出承诺和保证，也不对因互联网或通讯等原因造成的信息不完整、泄露等而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

2、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告等。

二、红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记机构将其所获红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额，不收取手续费。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

三、电子化服务

1、手机短信服务

本公司将为基金份额持有人提供每周净值、电子月度对账单，基金份额持有人可致电客服热线人工应答预留手机号码要求定制。

2、电子邮件服务

基金份额持有人可以通过本公司客户服务热线定制各类电子邮件服务，如基金份额周净值、电子月度对账单。

3、电子直销服务

基金份额持有人可以通过公司官网（www.spdbfunds.com）、微信公众号及 APP 客户端办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易明细查询和账户资料查询等各类业务。

四、客户服务中心

1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自助语音服务和查询服务，客户可通过电话收听基金份额净值，自助查询基金账户余额信息、交易确认情况等。同时，呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

2、网上客户服务

浦银基金网站为基金份额持有人提供查询服务和资讯服务。基金份额持有人在本公司网站“登录”后，即可 7*24 小时查询账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等；此外，还可查询热点问题及其解答，查阅投资刊物等。

公司网址：www.spdbfunds.com

客服信箱：service@spdbfunds.com

五、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客服热线自动语音留言、客服热线人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过其他销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

六、服务渠道

1、客服电话：400-8828-999 或（021）33079999

2、客服传真：（021）23212999

3、公司网站：www.spdbfunds.com

4、客服邮箱：service@spdbfunds.com

第二十二部分 其他应披露事项

本基金招募说明书更新期间，本基金及基金管理人的有关公告如下：

1、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金招募说明书；

2、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同；

3、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金托管协议；

4、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告；

5、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告；

6、2025 年 07 月 01 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要；

7、2025 年 07 月 26 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告；

8、2025 年 08 月 02 日，关于浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告；

9、2025 年 08 月 02 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告；

10、2025 年 08 月 02 日，关于浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告；

11、2025 年 08 月 02 日，关于浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金在部分代销机构参加费率优惠活动的公告；

12、2025 年 08 月 08 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票及相关风险提示的公告；

13、2025 年 08 月 08 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新；

14、2025 年 08 月 29 日，浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股

票估值方法的公告；

15、2025 年 09 月 02 日，关于浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金新增西南证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

16、2025 年 09 月 06 日，浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告；

17、2025 年 09 月 10 日，浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告；

18、2025 年 10 月 28 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告；

19、2025 年 11 月 08 日，浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告；

20、2025 年 11 月 17 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

21、2025 年 11 月 26 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并开通定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

22、2025 年 12 月 02 日，浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告；

23、2025 年 12 月 17 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

24、2026 年 01 月 08 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

25、2026 年 01 月 22 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告；

26、2026 年 01 月 29 日，浦银安盛基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告；

27、2026 年 01 月 29 日，浦银安盛基金管理有限公司关于公司股东变更的

公告；

28、2026 年 02 月 09 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华创证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

29、2026 年 02 月 14 日，浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告；

30、2026 年 03 月 13 日，浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告；

31、2026 年 03 月 30 日，浦银安盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）；

32、2026 年 03 月 31 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金 2025 年年度报告；

33、2026 年 04 月 15 日，浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告；

34、2026 年 04 月 22 日，浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告；

35、2026 年 04 月 30 日，2025 年度浦银安盛基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露。

第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，存放在基金管理人、基金托管人等机构的办公场所和营业场所，供投资者查阅；投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件。但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十四部分 备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

（一）中国证监会关于准予本基金注册的批复

（二）浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同

（三）浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金托管协议

（四）浦银基金管理有限公司开放式基金业务规则

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件和营业执照

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件

浦银基金管理有限公司

二〇二六年八月十七日