博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金
更新招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金经中国证监会 2015 年 3 月 13 日证监许可[2015]393 号文准予注册。

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

本基金的标的指数为中证淘金大数据 100 指数，编制方案如下：

（1）样本空间

同中证全指指数的样本空间

（2）选样方法

对样本空间内证券，按照综合财务因子、市场驱动因子和大数据因子计算的综合评分由高到低排名，选取排名前 100 的上市公司证券作为指数样本。单个证券的综合评分计算如下：

1）综合财务因子：

选取估值类因子，包括：市盈率、市净率、市销率、资产市值比等；成长类因子，包括：主营业务收入增长率、净利润增长率、EPS 增长率、总资产增长率等，根据上述所有因子长期历史回报和稳定性进行加权计算，得到综合财务因子；

2）市场驱动因子：

选取短期收益率、长期收益率、特定波动率、交易量变化、自由流通市值等，再根据上述所有因子的长期历史回报和稳定性进行加权计算，得到市场驱动因子；

3）大数据因子：

选取线上销售数据、分析师预期数据、新闻舆情数据、专利数据，构建选股指标，包括：销售金额增长率、价格变化率、分析师预期变化率、舆情情感得分、专利得分等，根据上述所有因子的长期历史回报和稳定性进行加权计算，得到大数据因子；

4）综合评分：

以综合财务因子、市场驱动因子、大数据因子相应长期及近期历史表现间的相关性作为加权依据，对这三类因子得分进行加权计算，得到各证券综合评分。

（3）指数计算

计算公式为：报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000。其中，调整市值＝Σ(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间，以使所有样本股权重相等。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、职业道德风险、流动性风险、合规性风险、本基金特定投资策略带来的风险及其他风险等。本基金属于股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，同时，本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券、货币市场工具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的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金与传统指数基金存在差异，本基金的特有风险包括基金管理人主动量化选股模型存在失效导致基金表现不佳的风险等。并且，指数的历史业绩仅能代表过去选股策略的结果，并不能代表标的指数和本基金未来的表现。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；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。

本基金以 1.00 元初始面值募集基金份额，在市场波动等因素的影响下，基金投资有可能出现亏损或基金份额净值低于初始面值。

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

本招募说明书更新所载内容截止日为 2026 年 8 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日。（财务数据未经审计）

目录

【重要提示】 2
第一部分 绪言 6
第二部分 释义 7
第三部分 基金管理人 12
第四部分 基金托管人 22
第五部分 相关服务机构 25
第六部分 基金的募集与基金合同的生效 60
第七部分 基金份额的申购与赎回 61
第八部分 基金的投资 74
第九部分 基金的业绩 85
第十部分 基金的财产 87
第十一部分 基金资产的估值 88
第十二部分 基金的收益分配 93
第十三部分 基金费用与税收 95
第十四部分 基金的会计与审计 99
第十五部分 基金的信息披露 100
第十六部分 风险揭示 106
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 112
第十八部分 基金合同的内容摘要 114
第十九部分 基金托管协议的内容摘要 129
第二十部分 对基金份额持有人的服务 144
第二十一部分 其他应披露的事项 147
第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式 149
第二十三部分 备查文件 150

第一部分 绪言

《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）以及《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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：指博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金

2、基金管理人：指博时基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同：指《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告：指《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金份额发售公告》

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

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经 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 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指博时基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、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

28、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

29、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

30、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

31、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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

36、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

37、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

38、《业务规则》：指《博时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

39、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

40、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

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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%

46、元：指人民币元

47、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

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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、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

51、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

52、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

53、基金份额分类：指本基金分设三类基金份额：A 类基金份额、C 类基金份额和 I 类基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数

54、A 类基金份额、I 类基金份额：指在投资者申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、C 类基金份额：指在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、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

57、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

58、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证淘金大数据 100 指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数

59、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

60、基金产品资料概要：指《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

第三部分　基金管理人

一、基金管理人概况

名称：　博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人：张东

成立时间：　1998 年 7 月 13 日

注册资本：　2.5 亿元人民币

存续期间：　持续经营

联系人：　杜松岭

联系电话：　（0755）8316　9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理股份有限公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；浙江省国际贸易集团有限公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

张东先生，硕士，董事长。1989 年至 2024 年先后在中国银行、招商银行从事零售金融、财富业务和财务会计等工作。2024 年加入博时基金管理有限公司，2024 年 5 月至 2025 年 10 月任公司总经理。自 2024 年 7 月 5 日起，任博时基金管理有限公司董事。2025 年 10 月 15 日至 2025 年 11 月 10 日代为履行博时基金管理有限公司总经理职务。自 2025 年 10 月 15 日起，任博时基金管理有限公司董事长。自 2026 年 2 月 12 日起代为履行博时基金管理有限公司首席信息官职责。

李德林先生，现任招商局金融控股有限公司副总经理。武汉大学金融学专业在职博士，高级经济师。曾任建银国际控股有限公司总裁助理，中德证券有限责任公司执行委员会委员，德意志银行董事总经理、中国区金融机构主管，招商银行总行办公室主任、战略客户部总经理兼机构客户部总经理，招商银行上海分行行长，招商银行行长助理、副行长等职务。

陈宇先生，总经理。曾任中国工商银行总行基金托管部客户经理/副主任科员（曾借调至中国证监会基金监管部三处任产品审核员），华夏银行总行基金托管部副处长、资产托管部处长，泰康资产管理有限责任公司营销总监、首席产品官、董事总经理、公司执行委员会成员，中邮人寿保险股份有限公司首席投资官。2017 年 7 月至 2025 年 9 月在招商局仁和人寿保险股份有限公司工作，历任首席投资官（兼资产管理中心总经理）、副总经理、首席运营官（COO）（集团二级公司总经理级）（期间 2019 年 5 月至 2025 年 5 月兼任招商局仁和养老投资有限公司 CEO）。2025 年加入博时基金管理有限公司，自 2025 年 11 月 11 日起，任公司总经理。

郝宇先生，硕士。1989 年 7 月至 1993 年 3 月在广东湛化企业集团公司工作，任财务部会计主任。1993 年 3 月至 1997 年 1 月在珠海深达实业投资有限公司工作，任财务部经理。1997 年 1 月至 2004 年 8 月在深圳招商房地产有限公司工作，历任职工董事、工会主席、财务副总监。2004 年 8 月至 2005 年 10 月在贵州省威宁彝族回族苗族自治县政府工作，任副县长。2005 年 10 月至 2011 年 12 月在深圳市招商创业有限公司工作，历任副总经理、财务总监。2012 年 1 月至 2016 年 7 月在招商局蛇口工业区控股股份有限公司工作，历任招标采购部总经理、产品管理中心副总经理。2016 年 7 月至 2018 年 2 月在招商局集团工作，任财务部部长助理。2018 年 2 月至 2025 年 11 月，在深圳市招商平安资产管理有限责任公司工作，历任党委委员、财务总监、纪委书记。2025 年 11 月至今，任招商局集团有限公司派出的专职外部董事。

郭智君先生，高级经济师。1993 年 7 月至 2000 年 2　月历任中国农业银行内蒙古分行会计、信贷员、人事教育处科员、副主任科员。2000 年 2 月至 2008 年 5 月历任中国长城资产管理公司呼和浩特办事处副处长、处长。2008 年 5 月至 2013 年 1 月历任中国长城资产管理公司人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理。2013 年 1 月至 2022 年 2 月历任中国长城资产管理股份有限公司内蒙古分公司党委副书记、副总经理（主持工作）、总经理、党委书记。2022 年 2 月至今历任中国长城资产管理股份有限公司资产经营六部总经理级干部、总经理。

方瓯华先生，复旦大学硕士，中级经济师。2009 年起，加入交通银行，历任交行上海分行市南支行、大客户二部、授信部、宝山支行行长助理等职位，主要负责营运及个人金融业务。2011 年起，调入交通银行投资部，担任高级经理，负责交行对外战略投资及对下属子公司股权管理工作。2015 年，加入上海信利股权投资基金管理有限公司并工作至今，历任高级投资经理、总经理、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司总经理、上海盛业股权投资基金公司执行董事（法人代表）、上海永泰房地产开发公司总经理等职，负责公司整体运营。2018 年，出任博时基金管理公司第七届董事会董事，2021 年卸任。自 2022 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事。

邹月娴女士，香港大学博士，新加坡归国学者。现任北京大学教授/博士生导师，北京大学深圳研究生院党委副书记，鹏城实验室兼职教授，中国计算机学会语音对话与听觉专委会委员，中国自动化学会模式识别与机器智能专业委员会委员，深圳市人工智能学会常务副理事长兼秘书长；荣获深圳市地方级高层次专业人才、深圳市三八红旗手等称号；曾获中国电子工业部科技进步三等奖，深圳市科学技术奖技术开发一等奖；在国际顶级期刊和旗舰会议发表高水平论文 300 多篇，入选全球前 2%顶尖科学家榜单。

陆海天先生，法学博士。现任香港理工大学内地发展处总监、可持续技术基金会会计及金融学教授。历任香港理工大学商学院副院长、会计及金融学院副院长、纽约大学斯特恩商学院客座研究教授。香港理工大学终身教授。

张博辉先生，2008 年 8 月参加工作，新加坡南洋理工大学金融学专业毕业，博士研究生学历，博士学位。2008 年至 2018 年在澳大利亚新南威尔士大学工作，历任金融系讲师、副教授、国际金融中心副主任、教授。2017 年至今在香港中文大学（深圳）工作，历任深圳高等金融研究院副院长、经管学院执行副院长，现任经管学院执行院长、校长讲座教授、深圳数据经济研究院副院长、深圳高等金融研究院金融科技与社会金融研究中心主任。

方芳女士，上海财经大学国民经济学专业博士、加拿大不列颠哥伦比亚大学访问学者。1985 年 7 月至今，就职于上海财经大学。历任上海财经大学公共经济与管理学院副院长、上海财经大学公共经济与管理学院党委书记。2023 年 2 月至今，任上海财经大学财税投资学院投资发展研究院院长、金融硕士（首席投资官）教育项目中心主任。同时，任世界华人不动产学会副秘书长、中国基本建设优化研究会理事、上海市投资学会会员等社会职务。

贺春临女士，现任博时基金管理有限公司工会主席，中共党员。先后在武汉大学获法学学士学位、法学硕士学位及经济学博士学位。2003 年 6 月至 2013 年 10 月在招商银行总行

工作，历任银行业务研究员、企业文化中心经理、办公室高级经理、品牌管理室主管。2013 年 10 月至今在博时基金管理有限公司工作，历任总裁办公室副总经理、战略发展中心总经理、董事会办公室副总经理、董事会办公室总经理兼党委宣传部部长、战略发展部首席战略官兼党委宣传部部长、党委宣传部部长、工会主席等。

2、高级管理人员

张东先生，简历同上。

陈宇先生，简历同上。

吴慧峰先生，硕士，副总经理、财务负责人、董事会秘书。1996 年至 2023 年先后在中国南山开发集团股份有限公司、上海诚南房地产开发有限公司、招商局金融集团有限公司、招商证券股份有限公司从事财务、公司管理等工作。2023 年加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理、财务负责人、董事会秘书，兼任博时资本管理有限公司董事长和博时财富基金销售有限公司董事。

吴曼女士，硕士，督察长。2003 年至 2024 年先后在中国证券监督管理委员会深圳监管局历任副主任科员、主任科员、副处长等职务，北京市君合（深圳）律师事务所任合伙人，招商证券股份有限公司任法律合规部总经理，其中 2021 年 1 月至 2022 年 6 月兼任招商证券资产管理有限公司合规总监。2024 年加入博时基金管理有限公司，现任公司督察长。

3、本基金基金经理

杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交

易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 日—至今)的基金经理。

本基金历任基金经理：赵云阳（2015 年 5 月 4 日-2016 年 5 月 30 日）、桂征辉（2015 年 7 月 21 日-2024 年 7 月 5 日）。

4、投资决策委员会成员

公司首席资产配置官黄健斌先生。

公司投资决策委员会专职委员兼年金投资部总经理于善辉先生。

首席基金经理过钧先生。

首席投资官兼权益投研一体化总监、境外投资部总经理曾鹏先生。

董事总经理兼权益投资三部总经理、权益投资三部投资总监蔡滨先生。

行业研究部总经理魏立先生。

宏观策略部首席策略分析师陈显顺先生。

指数与量化投资部总经理兼指数与量化投资部投资总监赵云阳先生。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回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、各类基金份额的申购、赎回价格；

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，不向他人泄露；

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

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

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

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

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

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

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。

四、基金管理人的承诺

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

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

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的法律合规部，法律合规部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行检查。

（3）相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，法律合规部负责检查公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

（2）风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

（3）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）法律合规部

法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行检查，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

（5）风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

（6）业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度

公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人情况

（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、行业监管规章和本行内有关管理规定，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、基金份额销售机构

1、直销机构

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

电话：010-65187055

传真：010-65187032

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

2、代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人：	廖林
客户服务电话：	95588
网址：	http://www.icbc.com.cn/

(2)中国农业银行股份有限公司

注册地址：	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：	北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人：	谷澍
客户服务电话：	95599
网址：	http://www.abchina.com

(3)交通银行股份有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址：	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
法定代表人：	任德奇
联系人：	高天
电话：	021-58781234
传真：	021-58408483
客户服务电话：	95559
网址：	http://www.bankcomm.com/

(4)招商银行股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：	缪建民
联系人：	季平伟
电话：	0755－83198888
传真：	0755－83195049
客户服务电话：	95555
网址：	http://www.cmbchina.com/

(5)中信银行股份有限公司

注册地址：	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址：	北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦
法定代表人：	方合英
联系人：	王晓琳
电话：	010－89937325
客户服务电话：	95558
网址：	http://bank.ecitic.com/

(6)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：	上海市中山东一路 12 号
办公地址：	上海市北京东路 689 号东银大厦 25 楼
法定代表人：	张为忠
客户服务电话：	95528
网址：	http://www.spdb.com.cn

(7)兴业银行股份有限公司

注册地址：	福州市湖东路 154 号
办公地址：	上海市江宁路 168 号
法定代表人：	吕家进
联系人：	曾鸣
电话：	021-52629999
客户服务电话：	95561
网址：	www.cib.com.cn

(8)中国民生银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址：	北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人：	高迎欣
联系人：	王继伟
电话：	010－58560666
传真：	010－57092611
客户服务电话：	95568
网址：	http://www.cmbc.com.cn/

(9)中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址：	北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：	郑国雨
传真：	010－68858117
客户服务电话：	95580
网址：	http://www.psbc.com

(10)北京银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址：	北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人：	张东宁
联系人：	周黎
传真：	010－66226045
客户服务电话：	95526
网址：	http://www.bankofbeijing.com.cn/

(11)华夏银行股份有限公司

注册地址：	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址：	北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人：	杨书剑
联系人：	郑鹏
电话：	010－85238667
传真：	010－85238680
客户服务电话：	95577
网址：	http://www.hxb.com.cn/

(12)广发银行股份有限公司

注册地址：	广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址：	广州市越秀区东风东路 713 号
法定代表人：	王凯
联系人：	刘伟
电话：	020-38321497/020-38322566
传真：	020-38321676
客户服务电话：	4008308003
网址：	http://www.cgbchina.com.cn/

(13)平安银行股份有限公司

注册地址：	深圳市深南东路 5047 号
办公地址：	深圳市深南东路 5047 号
法定代表人：	谢永林
联系人：	施艺帆
电话：	021-50979384
传真：	021-50979507
客户服务电话：	95511-3
网址：	http://bank.pingan.com

(14)宁波银行股份有限公司

注册地址：	宁波市鄞州区宁南南路 700 号
办公地址：	宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人：	陆华裕
联系人：	胡技勋
电话：	0574-89068340
传真：	0574-87050024
客户服务电话：	95574
网址：	http://www.nbcb.com.cn

(15)上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：	上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
办公地址：	上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
法定代表人：	冀光恒
联系人：	施传荣
电话：	021－38576666
传真：	021－50105124
客户服务电话：	021-962999;4006962999
网址：	http://www.srcb.com/

(16)杭州银行股份有限公司

注册地址：	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦
办公地址：	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦
法定代表人：	陈震山
联系人：	严峻
电话：	0571－85108195
传真：	0571－85106576
客户服务电话：	95398
网址：	http://www.hzbank.com.cn

(17)南京银行股份有限公司

注册地址：	南京市白下区淮海路 50 号
办公地址：	南京市玄武区中山路 288 号
法定代表人：	林复
联系人：	刘晔
电话：	025－86775335
传真：	025－86775376
客户服务电话：	95302
网址：	http://www.njcb.com.cn

(18)汉口银行股份有限公司

注册地址：	江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦
办公地址：	武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦
法定代表人：	陈新民
联系人：	张晓欢

电话：	027-82656924
传真：	027-82656099
客户服务电话：	96558（武汉）；40060-96558（全国）
网址：	http://www.hkbchina.com

(19)江苏银行股份有限公司

注册地址：	南京市洪武北路 55 号
办公地址：	南京市中华路 26 号
法定代表人：	夏平
联系人：	田春慧
电话：	025-58587018
传真：	025-58587038
客户服务电话：	95319
网址：	http://www.jsbchina.cn

(20)江苏张家港农村商业银行股份有限公司

注册地址：	张家港市杨舍镇人民中路 66 号
办公地址：	张家港市杨舍镇人民中路 66 号
法定代表人：	王自忠
联系人：	孙瑜
电话：	0512-58236370
传真：	0512-58236370
客户服务电话：	0512-96065
网址：	http://www.zrcbank.com

(21)哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：	哈尔滨市道里区尚志大街 160 号
办公地址：	哈尔滨市道里区上江街 888 号
法定代表人：	郭志文
联系人：	李至北
电话：	0451-87792450
传真：	0451-87792682
客户服务电话：	95537
网址：	http://www.hrbb.com.cn

(22)东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号
办公地址：	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦
法定代表人：	王耀球
联系人：	杨亢
电话：	0769-22866270
传真：	0769-22866282
客户服务电话：	961122
网址：	http://www.drcbank.com/

(23)河北银行股份有限公司

注册地址：	河北省石家庄市建设南大街 21 号
办公地址：	河北省石家庄市建设南大街 21 号
法定代表人：	梅爱斌
联系人：	李博
电话：	0311-88627587
传真：	0311-88627027
客户服务电话：	400-612-9999
网址：	http://www.hebbank.com

(24)嘉兴银行股份有限公司

注册地址：	嘉兴市昌盛南路 1001 号
办公地址：	嘉兴市昌盛南路 1001 号
法定代表人：	林斌
联系人：	顾晓光
电话：	0573-82099660
传真：	0573-82099660
客户服务电话：	0573-96528
网址：	http://www.jxccb.com/

(25)江苏苏州农村商业银行股份有限公司

注册地址：	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
办公地址：	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
法定代表人：	徐晓军
联系人：	葛晓亮
电话：	0512-63969209
传真：	0512-63969209
客户服务电话：	956111
网址：	www.szrcb.com

(26)江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：	常州市武进区延政中路 9 号
办公地址：	常州市武进区延政中路 9 号
法定代表人：	陆向阳
联系人：	李仙
电话：	0519-80585939
传真：	0519-89995170
客户服务电话：	0519-96005
网址：	http://www.jnbank.com.cn

(27)广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：	广州市天河区珠江新城华夏路 1 号
办公地址：	广州市天河区珠江新城华夏路 1 号
法定代表人：	王继康

联系人：	王帆
电话：	020-28852675
传真：	020-28852675
客户服务电话：	95313
网址：	www.grcbank.com

(28)成都农村商业银行股份有限公司

注册地址：	四川省成都市武侯区科华中路 88 号
办公地址：	四川省成都市武侯区科华中路 88 号
法定代表人：	王辉
联系人：	杨琪
电话：	028-85029649
传真：	028-85190961
客户服务电话：	95392
网址：	http://www.cdrcb.com/

(29)苏州银行股份有限公司

注册地址：	江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号
办公地址：	江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号
法定代表人：	崔庆军
联系人：	吴骏
电话：	0512-69868373
传真：	0512-69868370
客户服务电话：	96067
网址：	www.suzhoubank.com

(30)威海银行股份有限公司

注册地址：	山东省威海市青岛北路 137A 号
办公地址：	济南市经十路 11666 号奥体金融中心 D 栋
法定代表人：	孟东晓
联系人：	杨童童
电话：	0531-68978175
传真：	0531-68978176
客户服务电话：	省内 96636、境内 4000096636
网址：	http://www.whccb.com/

(31)四川天府银行股份有限公司

注册地址：	四川省南充市顺庆区涪江路 1 号
办公地址：	四川省南充市滨江中路一段 97 号 26 栋泰和尚渡南充市商业银行
法定代表人：	黄光伟
联系人：	李俊辉
电话：	0817-7118079
传真：	0817-7118322

客户服务电话：	400-16-96869
网址：	www.tf.cn

(32)晋商银行股份有限公司

注册地址：	山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦
办公地址：	山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦
法定代表人：	阎俊生
联系人：	董嘉文
电话：	0351-6819926
传真：	0351-6819926
客户服务电话：	95105588
网址：	http://www.jshbank.com

(33)恒丰银行股份有限公司

注册地址：	山东省济南市历下区泺源大街 8 号
办公地址：	上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦
法定代表人：	陈颖
联系人：	孔晓晴
电话：	0531-59666666
传真：	0531-59666666
客户服务电话：	95395
网址：	www.hfbank.com.cn

(34)浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

注册地址：	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号
办公地址：	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号
法定代表人：	俞俊海
联系人：	孟建潮
电话：	0575-84788101
传真：	0575-84788134
客户服务电话：	400-889-6596
网址：	http://www.borf.cn

(35)天相投资顾问有限公司

注册地址：	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座
办公地址：	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层
法定代表人：	林义相
联系人：	尹伶
电话：	010-66045529
传真：	010－66045500
客户服务电话：	010-66045678
网址：	http://www.txsec.com

(36)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：	深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业

	园 2 栋 3703-A
办公地址：	北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 6 层
法定代表人：	张斌
联系人：	张燕
电话：	010-58325388
传真：	010-58325300
客户服务电话：	4000661199-2
网址：	www.xinlande.com.cn

(37)江苏天鼎证券投资咨询有限公司

注册地址：	南京市秦淮区太平南路 389 号 1002 室
办公地址：	南京市鼓楼区平安里 74 号
法定代表人：	金婷婷
联系人：	黄丹昀
电话：	025-66001159
传真：	025-66001172
客户服务电话：	025-962155
网址：	www.tdtz888.com

(38)上海挖财基金销售有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室
办公地址：	上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 5 层 01、02、03 室
法定代表人：	吕柳霞
联系人：	陈璐
电话：	021-50810687
传真：	021-58300279
客户服务电话：	021-50810673
网址：	http://wacaijijin.com/

(39)贵州省贵文文化基金销售有限公司

注册地址：	贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际 A 栋 2 单元 5 层 17 号
办公地址：	贵州省贵阳市龙洞堡兴业西路 CCDI 版权云工作基地　二楼
法定代表人：	陈成
联系人：	李辰
电话：	17601206766
客户服务电话：	0851-85407888
网址：	https://www.gwcaifu.com/

(40)腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：	深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层
法定代表人：	刘明军
联系人：	谭广锋
传真：	0755-86013399
客户服务电话：	95788
网址：	https://www.txfund.com/

(41)北京度小满基金销售有限公司

注册地址：	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室
办公地址：	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼
法定代表人：	葛新
联系人：	孙博超
电话：	010-59403028
传真：	010-59403027
客户服务电话：	95055-4
网址：	www.duxiaomanfund.com

(42)博时财富基金销售有限公司

注册地址：	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层
办公地址：	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层
法定代表人：	杜松岭
联系人：	崔丹
电话：	0755-83169999
传真：	0755-83195220
客户服务电话：	400-610-5568
网址：	www.boserawealth.com

(43)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址：	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人：	薛峰
联系人：	童彩平
电话：	0755-33227950
传真：	0755-33227951
客户服务电话：	400-678-8887
网址：	https://www.zlfund.cn/

(44)上海天天基金销售有限公司

注册地址：	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：	上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法定代表人：	其实
联系人：	潘世友

电话：	021-54509998
传真：	021-64385308
客户服务电话：	400-181-8188
网址：	http://www.1234567.com.cn

(45)上海好买基金销售有限公司

注册地址：	上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址：	上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室
法定代表人：	杨文斌
联系人：	张茹
电话：	021-20613610
客户服务电话：	400-700-9665
网址：	http://www.howbuy.com

(46)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室
办公地址：	浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号
法定代表人：	王珺
联系人：	韩爱彬
电话：	021-60897840
传真：	0571-26697013
客户服务电话：	95188-8
网址：	http://www.fund123.cn

(47)上海长量基金销售有限公司

注册地址：	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：	上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：	张跃伟
联系人：	敖玲
电话：	021-58788678-8201
传真：	021—58787698
客户服务电话：	400-820-2899
网址：	http://www.erichfund.com

(48)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：	杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室
办公地址：	浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼
法定代表人：	凌顺平
联系人：	吴杰
电话：	0571-88911818
传真：	0571-86800423
客户服务电话：	952555
网址：	www.5ifund.com

(49)上海利得基金销售有限公司

注册地址：	上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址：	上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人：	李兴春
联系人：	徐鹏
电话：	021-50583533
传真：	021-50583633
客户服务电话：	400-921-7755
网址：	http://a.leadfund.com.cn/

(50)嘉实财富管理有限公司

注册地址：	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元
办公地址：	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层
法定代表人：	赵学军
联系人：	余永键
电话：	010-85097570
传真：	010-65215433
客户服务电话：	400-021-8850
网址：	www.harvestwm.cn

(51)宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：	北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址：	北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809
法定代表人：	戎兵
联系人：	程刚
电话：	010-52855713
传真：	010-85894285
客户服务电话：	400-609-9200
网址：	http://www.yixinfund.com

(52)南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：	南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址：	南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人：	钱燕飞
联系人：	喻明明
电话：	025-66996699-884131
传真：	025-66996699-884131
客户服务电话：	95177
网址：	www.snjijin.com

(53)浦领基金销售有限公司

注册地址：	北京市朝阳区建国路乙 118 号 16 层 1611
办公地址：	北京市朝阳区建国路乙 118 号 16 层 1611

法定代表人：	张莲
联系人：	李艳
电话：	010-59497361
客户服务电话：	400-012-5899
网址：	www.prolinkfund.com

(54)华源证券股份有限公司（鑫理财）

注册地址：	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号
办公地址：	湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F
法定代表人：	邓晖
联系人：	从瑞丰
电话：	15069421014
传真：	-
客户服务电话：	95305
网址：	www.huayuanstock.com

(55)北京汇成基金销售有限公司

注册地址：	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2
办公地址：	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2
法定代表人：	王伟刚
联系人：	丁向坤
电话：	010-56282140
传真：	010-62680827
客户服务电话：	010-63158805
网址：	www.hcfunds.com

(56)上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
办公地址：	上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
法定代表人：	张俊
联系人：	张蜓
电话：	021-20219988-35374
传真：	021-20219923
客户服务电话：	021-20292031
网址：	wg.com.cn

(57)上海万得基金销售有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址：	上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人：	王廷富
联系人：	姜吉灵
电话：	021-5132　7185
传真：	021-6888　2281
客户服务电话：	400-821-0203

网址：	www.520fund.com.cn

(58)上海联泰基金销售有限公司

注册地址：	上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室
办公地址：	上海市虹口区溧阳路 735 号 2 幢 3 层
法定代表人：	尹彬彬
联系人：	兰敏
电话：	021-62680166
传真：	021-52975270
客户服务电话：	400-118-1188
网址：	www.66liantai.com

(59)上海基煜基金销售有限公司

注册地址：	上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元
办公地址：	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人：	王翔
联系人：	蓝杰
电话：	021-65370077
传真：	021-55085991
客户服务电话：	400-820-5369
网址：	www.jiyufund.com.cn

(60)上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：	上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室
办公地址：	上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室
法定代表人：	黄欣
联系人：	何源
电话：	021-33768132
传真：	021-33768132-802
客户服务电话：	4006767523
网址：	www.zhongzhengfund.com

(61)深圳新华信通基金销售有限公司

注册地址：	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：	深圳市福田区深南大道 2003 号华嵘大厦 710 室
法定代表人：	戴媛
联系人：	郭佶欣
电话：	15135080478
客户服务电话：	400-000-5767
网址：	www.xintongfund.com

(62)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址：	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：	郭坚
联系人：	宁博宇
电话：	021-20665952
传真：	021-22066653
客户服务电话：	400-821-9031
网址：	www.lufunds.com

(63)珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址：	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：	肖雯
联系人：	吴煜浩
电话：	020-89629099
传真：	020-89629011
客户服务电话：	020-89629066
网址：	www.yingmi.cn

(64)和耕传承基金销售有限公司

注册地址：	河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503
办公地址：	河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503
法定代表人：	温丽燕
联系人：	董亚芳
电话：	0371-85518396
传真：	0371-85518397
客户服务电话：	400-0555-671
网址：	www.hgccpb.com

(65)京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：	北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15
办公地址：	北京市经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 4 层 A428 室
法定代表人：	王珊珊
联系人：	文雯
电话：	400-098-8511
传真：	010-89188000
客户服务电话：	400-088-8816
网址：	http://jr.jd.com/

(66)深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：	深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址：	深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108
法定代表人：	赖任军
联系人：	刘昕霞
电话：	0755-29330513
传真：	0755-26920530
客户服务电话：	400-822-4888
网址：	www.jfzinv.com

(67)北京雪球基金销售有限公司

注册地址：	北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：	北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：	李楠
联系人：	戚晓强
电话：	15810005516
传真：	010-85659484
客户服务电话：	400-061-8518
网址：	danjuanapp.com

(68)深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址：	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：	深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室
法定代表人：	杨艳平
联系人：	叶见云
电话：	0755-86575665
传真：	0755-26640652
客户服务电话：	4001286800
网址：	www.caiho.cn

(69)上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 502 室
办公地址：	上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层
法定代表人：	许欣
联系人：	刘弘义
电话：	15608193006
传真：	+86 21 35073616
客户服务电话：	021-68609700
网址：	https://www.zocaifu.com/

(70)上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：	上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址：	上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
法定代表人：	毛淮平
联系人：	张静怡

电话：	010-88066326
客户服务电话：	400-817-5666
网址：	https://www.amcfortune.com/

(71)洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：	山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室
办公地址：	山东省青岛市崂山区海尔路 188 号浦发银行大厦 706
法定代表人：	任淑桢
联系人：	任淑桢
电话：	0532-66728591
传真：	0532-66728591
客户服务电话：	400-670-6863
网址：	www.hongtaiwealth.com

(72)中信期货有限公司

注册地址：	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址：	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人：	张皓
联系人：	梁美娜
电话：	021-80365243
传真：	021-60819988
客户服务电话：	400-990-8826
网址：	www.citicsf.com

(73)国泰海通证券股份有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：	上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦
法定代表人：	朱健
联系人：	钟伟镇
电话：	021-38676666
传真：	021-38670666
客户服务电话：	95521/4008888666
网址：	https://www.gtht.com

(74)中信建投证券股份有限公司

注册地址：	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址：	北京市朝阳区光华路 10 号
法定代表人：	刘成
客户服务电话：	4008888108/95587
网址：	http://www.csc108.com/

(75)国信证券股份有限公司

注册地址：	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼
法定代表人：	张纳沙
联系人：	于智勇
电话：	0755-81981259
传真：	0755-82133952
客户服务电话：	95536
网址：	http://www.guosen.com.cn/

(76)招商证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址：	深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼
法定代表人：	朱江涛
客户服务电话：	95565
网址：	http://www.cmschina.com/

(77)广发证券股份有限公司

注册地址：	广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址：	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦
法定代表人：	林传辉
联系人：	黄岚
电话：	020－87555888
传真：	020－87555305
客户服务电话：	95575、020-95575 或致电各地营业网点
网址：	http://www.gf.com.cn/

(78)中信证券股份有限公司

注册地址：	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：	北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人：	张佑君
联系人：	杜杰
电话：	010-60833889
传真：	010－84865560
客户服务电话：	95548
网址：	http://www.cs.ecitic.com/

(79)中国银河证券股份有限公司

注册地址：	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址：	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
法定代表人：	王晟
电话：	010-80928123
客户服务电话：	4008-888-888 或 95551
网址：	http:// www.chinastock.com.cn/

(80)申万宏源证券有限公司

注册地址：	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层
法定代表人：	张剑
电话：	021-33388999
传真：	021-33388224
客户服务电话：	95523
网址：	www.swhysc.com

(81)长江证券股份有限公司

注册地址：	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号
办公地址：	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号
法定代表人：	刘正斌
联系人：	奚博宇
电话：	027-65799999
传真：	027-85481900
客户服务电话：	95579
网址：	http://www.95579.com/

(82)国投证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
办公地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
法定代表人：	王苏望
电话：	0755-82558266
客户服务电话：	95517
网址：	http://www.sdicsc.com.cn

(83)西南证券股份有限公司

注册地址：	重庆市江北区金沙门路 32 号
办公地址：	重庆市江北区金沙门路 32 号
法定代表人：	杨雨松
联系人：	宋涧乔
电话：	023-67747414
传真：	023-63786212
客户服务电话：	4008096096
网址：	http://www.swsc.com.cn

(84)湘财证券股份有限公司

注册地址：	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地址：	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人：	林俊波
联系人：	孙越
电话：	021-38784580-8920
客户服务电话：	95351
网址：	http://www.xcsc.com

(85)万联证券股份有限公司

注册地址：	广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层
办公地址：	广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层
法定代表人：	王达
联系人：	丁思
电话：	020-83988334
客户服务电话：	95322
网址：	http://www.wlzq.cn

(86)国元证券股份有限公司

注册地址：	安徽省合肥市寿春路 179 号
办公地址：	安徽省合肥市寿春路 179 号
法定代表人：	凤良志
联系人：	李蔡
电话：	0551－2272101
传真：	0551－2272100
客户服务电话：	全国统一热线 4008888777，安徽省内热线 96888
网址：	http://www.gyzq.com.cn

(87)渤海证券股份有限公司

注册地址：	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址：	天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人：	安志勇
联系人：	王星
电话：	022-23861692
传真：	022－28451892
客户服务电话：	956066
网址：	https://www.bhzq.com

(88)华泰证券股份有限公司

注册地址：	南京市江东中路 228 号
办公地址：	南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦
法定代表人：	张伟
电话：	0755-22660831
客户服务电话：	95597
网址：	http://www.htsc.com.cn/

(89)山西证券股份有限公司

注册地址：	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：	王怡里
电话：	0351－8686659
传真：	0351－8686619
客户服务电话：	4006661618

网址：	http://www.i618.com.cn/

(90)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
办公地址：	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人：	肖海峰
联系人：	赵如意
电话：	0532-85725062
客户服务电话：	95548
网址：	sd.citics.com

(91)东兴证券股份有限公司

注册地址：	北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层
办公地址：	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层
法定代表人：	魏庆华
联系人：	郑旷怡
电话：	010-66559039
传真：	010-66555133
客户服务电话：	95309
网址：	http://www.dxzq.net

(92)东吴证券股份有限公司

注册地址：	江苏省苏州市翠园路 181 号
办公地址：	江苏省苏州市星阳街 5 号
法定代表人：	范力
联系人：	陆晓
电话：	0512-62938521
传真：	0512－65588021
客户服务电话：	95330
网址：	https://www.dwzq.com.cn

(93)信达证券股份有限公司

注册地址：	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址：	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人：	祝瑞敏
联系人：	王薇安
电话：	010－83252170
传真：	010－63081344
客户服务电话：	95321
网址：	http://www.cindasc.com

(94)方正证券股份有限公司

注册地址：	湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层
办公地址：	湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层
法定代表人：	施华

联系人：	胡创
电话：	010-56437060
传真：	0731-85832214
客户服务电话：	95571
网址：	http://www.foundersc.com

(95)长城证券股份有限公司

注册地址：	深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层
办公地址：	深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：	丁益
联系人：	沈晓
电话：	0755-83464734
传真：	0755－83515567
客户服务电话：	4006666888
网址：	http://www.cgws.com

(96)光大证券股份有限公司

注册地址：	上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址：	上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：	刘秋明
联系人：	李芳芳
电话：	021-22169089
传真：	021－22169134
客户服务电话：	4008888788；95525
网址：	http://www.ebscn.com/

(97)中信证券华南股份有限公司

注册地址：	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址：	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人：	陈可可
联系人：	郭杏燕
电话：	020-88836999
传真：	020-88836984
客户服务电话：	95548
网址：	http://www.gzs.com.cn

(98)东北证券股份有限公司

注册地址：	长春市生态大街 6666 号
办公地址：	长春市生态大街 6666 号
法定代表人：	李福春
联系人：	安岩岩
电话：	0431-85096517
传真：	0431-85096795
客户服务电话：	95360

网址：	http://www.nesc.cn

(99)南京证券股份有限公司

注册地址：	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
办公地址：	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
法定代表人：	李剑锋
联系人：	潘月
电话：	025－52310569
传真：	025－52310586
客户服务电话：	4008285888
网址：	http://www.njzq.com.cn

(100)上海证券有限责任公司

注册地址：	上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼
办公地址：	上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼
法定代表人：	李俊杰
联系人：	魏熠珲
电话：	021-53686278
传真：	021-53686835
客户服务电话：	4008918918
网址：	https://www.shzq.com/

(101)诚通证券股份有限公司

注册地址：	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层
办公地址：	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层
法定代表人：	张威
电话：	010-83561146
客户服务电话：	95399
网址：	www.cctgsc.com.cn

(102)大同证券有限责任公司

注册地址：	山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
办公地址：	山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13
法定代表人：	董祥
联系人：	薛津
电话：	0351－4130322
传真：	0351-7219891
客户服务电话：	4007121212
网址：	www.dtsbc.com.cn

(103)平安证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
办公地址：	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：	何之江
联系人：	王阳
电话：	021-38632136
传真：	0755－82400862
客户服务电话：	0755-22628888/95511-8
网址：	http:www.stock.pingan.com

(104)华安证券股份有限公司

注册地址：	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址：	安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座
法定代表人：	章宏韬
联系人：	孙懿
电话：	0551-65161821
传真：	0551－65161672
客户服务电话：	95318
网址：	http://www.hazq.com/

(105)国海证券股份有限公司

注册地址：	广西桂林市辅星路 13 号
办公地址：	深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼
法定代表人：	张雅锋
联系人：	武斌
电话：	0755－83707413
传真：	0755－83700205
客户服务电话：	4008888100（全国），96100（广西）
网址：	http://www.ghzq.com.cn

(106)财信证券股份有限公司

注册地址：	长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼
办公地址：	湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋（B 座）21 层
法定代表人：	蔡一兵
联系人：	郭磊
电话：	0731-84403319
传真：	0731-84403439
客户服务电话：	0731-84403360
网址：	http://www.cfzq.com/

(107)东莞证券股份有限公司

注册地址：	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
办公地址：	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人：	潘海标
联系人：	叶玉琪
电话：	0769-22119351

传真：	0769-22115712
客户服务电话：	95328
网址：	http://www.dgzq.com.cn

(108)中原证券股份有限公司

注册地址：	郑州市郑东新区商务外环路 10 号
办公地址：	郑州市郑东新区商务外环路 10 号
法定代表人：	鲁智礼
联系人：	李盼盼
电话：	0371-69099882
传真：	0371--65585665
客户服务电话：	95377
网址：	http://www.ccnew.com/

(109)东海证券股份有限公司

注册地址：	江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址：	上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦
法定代表人：	钱俊文
联系人：	王一彦
电话：	021-20333333
传真：	021-50498825
客户服务电话：	95531； 4008888588
网址：	http://www.longone.com.cn

(110)金融街证券股份有限公司

注册地址：	内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼
法定代表人：	祝艳辉
联系人：	熊丽
电话：	0471－4972675
客户服务电话：	956088
网址：	http://www.cnht.com.cn/

(111)国盛证券股份有限公司

注册地址：	江西省南昌市新建区子实路 1589 号
办公地址：	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦
法定代表人：	刘朝东
联系人：	占文驰
电话：	0791－86283372
传真：	0791－6289395
客户服务电话：	956080
网址：	https://www.gszq.com/

(112)华西证券股份有限公司

注册地址：	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦
办公地址：	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：	杨炯洋
联系人：	赵静静
电话：	010-58124967
传真：	028-86150040
客户服务电话：	95584
网址：	https://www.hx168.com.cn/

(113)申万宏源西部证券有限公司

注册地址：	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
办公地址：	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
法定代表人：	王献军
联系人：	梁丽
电话：	0991-2307105
传真：	010-88085195
客户服务电话：	95523 或 4008895523
网址：	www.swhysc.com

(114)中泰证券股份有限公司

注册地址：	济南市市中区经七路 86 号
办公地址：	山东省济南市市中区经七路 86 号证券大厦 2309
法定代表人：	王洪
联系人：	张峰源
电话：	021-20315719
客户服务电话：	95538
网址：	www.zts.com.cn

(115)世纪证券有限责任公司

注册地址：	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406
办公地址：	广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 楼
法定代表人：	李强
联系人：	徐玲娟
电话：	0755-83199599-9135
传真：	0755－83199545
客户服务电话：	4008323000
网址：	http://www.csco.com.cn/

(116)第一创业证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址：	深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼
法定代表人：	青美平措

联系人：	单晶
电话：	0755-23838750
传真：	0755-25838701
客户服务电话：	95358
网址：	http://www.firstcapital.com.cn/

(117)华林证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼
办公地址：	深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼
法定代表人：	林立
电话：	0755－82707855
传真：	0755－23613751
客户服务电话：	4001883888
网址：	http://www.chinalin.com/

(118)德邦证券股份有限公司

注册地址：	上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：	上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：	武晓春
联系人：	刘熠
电话：	021-68761616
传真：	021-68767981
客户服务电话：	4008888128
网址：	http://www.tebon.com.cn

(119)西部证券股份有限公司

注册地址：	陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室
办公地址：	西安市新城区东新街 319 号
法定代表人：	徐朝晖
联系人：	张吉安
电话：	029-87211668
传真：	029-87406117
客户服务电话：	95582
网址：	http://www.west95582.com/

(120)华福证券股份有限公司

注册地址：	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址：	福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人：	黄德良
联系人：	王虹
电话：	021-20655183
传真：	0591－87383610
客户服务电话：	95547
网址：	http://www.hfzq.com.cn

(121)华龙证券股份有限公司

注册地址：	兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼
办公地址：	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 19 楼
法定代表人：	王锡真
电话：	0931-4890208
传真：	0931-4890628
客户服务电话：	95368
网址：	https://www.hlzq.com/

(122)中国国际金融股份有限公司

注册地址：	中国北京建国门外大街 1 号　国贸大厦 2 座 28 层
办公地址：	中国北京建国门外大街 1 号　国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人：	沈如军
联系人：	任敏
电话：	010－65051166
传真：	010－65051156
客户服务电话：	010-65051166
网址：	http://www.cicc.com.cn/

(123)财通证券股份有限公司

注册地址：	杭州市解放路 111 号
办公地址：	浙江省杭州市天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 1201 室
法定代表人：	陆建强
联系人：	蔡还
电话：	0571-87789160
传真：	0571－85071387
客户服务电话：	95336（上海地区 962336）
网址：	http://www.ctsec.com

(124)五矿证券有限公司

注册地址：	深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401
办公地址：	深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦（18-25 层）
法定代表人：	黄海洲
联系人：	赵晓棋
电话：	0755-23375447
客户服务电话：	4001840028
网址：	http://www.wkzq.com.cn

(125)华鑫证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房
办公地址：	上海市黄浦区福州路 666 号 6 楼

法定代表人：	俞洋
联系人：	刘熠
电话：	021-54967656
传真：	021-64333051
客户服务电话：	95323,021-32109999,029-68918888
网址：	http://www.cfsc.com.cn

(126)中国中金财富证券有限公司

注册地址：	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-4608
办公地址：	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层
法定代表人：	高涛
联系人：	万玉琳
电话：	0755-82026907
传真：	0755-82026539
客户服务电话：	4006008008/95532
网址：	http://www.china-invs.cn/

(127)中山证券有限责任公司

注册地址：	深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
办公地址：	深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
法定代表人：	李永湖
联系人：	罗艺琳
电话：	0755-82943755
传真：	0755-82960582
客户服务电话：	95329
网址：	http://www.zszq.com

(128)东方财富证券股份有限公司

注册地址：	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址：	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人：	戴彦
联系人：	付佳
电话：	021-23586603
传真：	021-23586860
客户服务电话：	95357
网址：	http://www.18.cn

(129)江海证券有限公司

注册地址：	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址：	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人：	孙名扬
联系人：	王金娇

电话：	0451-87765732
传真：	0451－82287211
客户服务电话：	956007
网址：	http://www.jhzq.com.cn

(130)国金证券股份有限公司

注册地址：	四川省成都市东城根上街 95 号
办公地址：	四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人：	冉云
联系人：	贾鹏
电话：	028-86690057、028-86690058
传真：	028-86690126
客户服务电话：	4006-600109/95310
网址：	http://www.gjzq.com.cn

(131)华宝证券股份有限公司

注册地址：	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼
办公地址：	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼
法定代表人：	刘加海
联系人：	刘闻川
电话：	021-68777222
传真：	021－68777822
客户服务电话：	4008209898;021-38929908
网址：	http://www.cnhbstock.com

(132)爱建证券有限责任公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼
办公地址：	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼
法定代表人：	祝健
联系人：	姚盛盛
电话：	021-32229888
传真：	021- 68728703
客户服务电话：	4001-962-502
网址：	http://www.ajzq.com

(133)英大证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：	吴骏
联系人：	吴尔晖
电话：	0755-83007159
传真：	0755-83007034
客户服务电话：	4000-188-688
网址：	http://www.ydsc.com.cn

(134)财达证券股份有限公司

注册地址：	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层
办公地址：	河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层
法定代表人：	翟建强
联系人：	刘亚静
电话：	0311-66006393
传真：	0311-66006249
客户服务电话：	4006128888
网址：	http://www.S10000.com

(135)万和证券股份有限公司

注册地址：	海南省海口市南沙路 49 号通信广场二楼
办公地址：	深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 层西厅
法定代表人：	甘卫斌
联系人：	张雷
电话：	0755-82830333
传真：	0755-25170093
客户服务电话：	4008-882-882
网址：	http://www.vanho.cn

(136)首创证券股份有限公司

注册地址：	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
办公地址：	北京市朝阳区安定路 5 号院北投投资大厦 A 座 18 层
法定代表人：	毕劲松
联系人：	刘宇
电话：	010－81152418
传真：	010－81152982
客户服务电话：	95381
网址：	www.sczq.com.cn

(137)联储证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼
办公地址：	深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼
法定代表人：	吕春卫
联系人：	张婉婷
电话：	010-86499765
传真：	0755-82075835
客户服务电话：	4006206868/010-56177851
网址：	http://www.lczq.com/

(138)华瑞保险销售有限公司

注册地址：	上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层
办公地址：	上海市浦东区向城路 288 号国华金融大厦 8 楼

法定代表人：	路昊
联系人：	张爽爽
电话：	021-68595976
传真：	021-68595766
客户服务电话：	4001115818
网址：	www.huaruisales.com

(139)玄元保险代理有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
办公地址：	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
法定代表人：	马永谙
联系人：	卢亚博
电话：	021-50701053
传真：	021-50701053
客户服务电话：	4000808208
网址：	www.licaimofang.com

(140)阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：	海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址：	北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室
法定代表人：	李科
联系人：	王超
电话：	010-59053660
传真：	010-85632773
客户服务电话：	95510
网址：	http://fund.sinosig.com/

(141)中国人寿保险股份有限公司

注册地址：	中国北京市西城区金融大街 16 号
办公地址：	中国北京市西城区金融大街 16 号
法定代表人：	白涛
联系人：	秦泽伟
电话：	010-63631539
传真：	010-66222276
客户服务电话：	95519
网址：	www.e-chinalife.com

(142)湖南银行股份有限公司

注册地址：	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 210 号
办公地址：	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 210 号
法定代表人：	黄卫忠
联系人：	张鹏君
电话：	0731-96599
传真：	0731-89828806

客户服务电话：	0731-96599
网址：	www.hunan-bank.com

(143)龙江银行股份有限公司

注册地址：	黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号
办公地址：	黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号
法定代表人：	张建辉
联系人：	闫勇
电话：	0451-85706107
传真：	0451-85706107
客户服务电话：	4006458888
网址：	www.lj-bank.com

(144)深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：	深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座
法定代表人：	顾敏
联系人：	白冰
电话：	89959999-3306
客户服务电话：	95384
网址：	http://www.webank.com/

(145)桂林银行股份有限公司

注册地址：	桂林市临桂区公园北路 8 号
办公地址：	桂林市临桂区公园北路 8 号
法定代表人：	吴东
联系人：	陈林锴
电话：	0773-3879905
传真：	0773-3820180
客户服务电话：	400-86-96299
网址：	www.guilinbank.com.cn

(146)德州银行股份有限公司

注册地址：	山东省德州市三八东路 1266 号
办公地址：	山东省德州市三八东路 1266 号
法定代表人：	孙玉芝
联系人：	王方震
电话：	0534-2297326
传真：	0534-2297327
客户服务电话：	40084-96588
网址：	www.dzbchina.com

(147)中原银行股份有限公司

注册地址：	河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦
办公地址：	河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

法定代表人：	徐诺金
联系人：	田力源
电话：	0371-61910219
传真：	0371-85519869
客户服务电话：	95186
网址：	www.zybank.com.cn

(148)兰州银行股份有限公司

注册地址：	甘肃省兰州市城关区酒泉路 211 号
办公地址：	甘肃省兰州市城关区酒泉路 211 号
法定代表人：	许建平
联系人：	司艳春
电话：	0931-4600239
传真：	0931-4600239
客户服务电话：	0931-96799
网址：	www.lzbank.com

(149)湖北银行股份有限公司

注册地址：	武汉市武昌区水果湖街中北路 86 号汉街总部国际 8 栋
办公地址：	武汉市武昌区水果湖街中北路 86 号汉街总部国际 8 栋
法定代表人：	陈大林
联系人：	李昕雅
电话：	027-87139129
传真：	027-87135931
客户服务电话：	（湖北）96599（全国）400-85-96599
网址：	http://www.hubeibank.cn

二、登记机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

法定代表人：张东

电话： 010-65171166

传真： 010-65187068

联系人：侣方方

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话： 021- 31358666

传真： 021- 31358600

负责人：俞卫锋

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

执行事务合伙人：刘维、肖厚发

联系电话：010-66001391

传真：010-66001392

联系人：吴琳杰

经办注册会计师：薛竞 吴琳杰

第六部分 基金的募集与基金合同的生效

一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于 2015 年 3 月 13 日中国证监会证监许可[2015]393 号文准予注册。

本基金募集期从 2015 年 4 月 27 日起至 2015 年 4 月 29 日止，基金份额博时中证淘金大数据 100A 共募集 3,513,120,283.01 份（含利息结转的份额），博时中证淘金大数据 100I 共募集 561,848,729.34 份（含利息结转的份额），两者合计共募集 4,074,969,012.35 份（含利息结转的份额），有效认购户数为 96,759 户。

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2015 年 5 月 4 日正式生效。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金在基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，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，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

第七部分　基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，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、赎回开始日及业务办理时间

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、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2015 年 6 月 5 日起开始办理申购赎回业务。

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基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的数额限制

1、A 类份额通过其他销售机构申购的，首次申购的最低金额为 10 元，追加申购最低金额为 10 元，各销售机构在不低于上述规定的前提下，可根据自己的情况调整首次最低申购金额和最低追加申购金额限制；通过直销机构申购 A 类份额的，首次申购的最低金额为 10 元，追加申购最低金额为 10 元。

2、I 类份额首次最低申购的最低金额为 10 元人民币，追加申购的最低金额为 10 元。

3、C 类份额首次最低申购的最低金额为 10 元人民币，　追加申购的最低金额为 10 元。

4、A 类份额每个交易账户最低持有基金份额余额为 10 份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 10 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

5、I 类份额每个交易账户最低持有基金份额余额为 1 份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 1 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

6、C 类份额每个交易账户最低持有基金份额余额为 10 份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 10 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

7、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告，但法律法规、监管机构的另有规定或基金合同另有约定的除外。

8、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。具体请参见相关公告。

9、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、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；

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。

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

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 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，则申购款项退还给投资人。

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。

六、申购费用、赎回费用

1、申购赎回费率

（1）A 类和 I 类基金份额的申购费和赎回费

本基金对通过直销中心申购 A 类基金份额的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

对于申购本基金 A　类基金份额的特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额的特定投资群体	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	0.48%
100 万元≤　M＜500 万元	0.32%
500 万元≤　M＜1000 万元	0.12%
M　≥　1000 万元	1000 元/笔

对于申购本基金 A　类基金份额的非特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的非特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	1.20%
100 万元≤　M＜500 万元	0.80%
500 万元≤　M＜1000 万元	0.30%
M　≥　1000 万元	1000 元/笔

A 类基金份额赎回费率：

表：A 类基金份额的赎回费率表

持有基金份额期限（Y）	赎回费率
Y ＜ 7 日	1.50%
7 日≤Y＜3 个月	0.30%
Y≥3 个月	0

I 类基金份额申购费率：

表：I 类基金份额的申购费率表

申购金额（M）	申购费率（%）
M＜100 万元	0.60%
100 万元≤M＜500 万元	0.40%
500 万元≤M＜1000 万元	0.30%
M≥1000 万元	1000 元/笔

I 类基金份额赎回费：

表：I 类基金份额的赎回费率表

持有基金份额期限（Y）	赎回费率（%）
Y ＜ 7 日	1.50%
7 日≤Y＜3 个月	0.30%
Y≥3 个月	0

（2）C 类基金份额的申购费与赎回费

1）本基金 C 类基金份额不收取申购费。

2）本基金 C 类基金份额赎回费率随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示：

持有基金份额期限（Y）	C 类基金份额的赎回费率
Y＜7 日	1.50%
Y≥7 日	0

赎回费用由赎回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。对于 A 类和 I 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者将不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

对于每份申购份额，持有期指自该基金份额申购确认日至赎回确认日（不含该日）。

2、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调低基金申购费率、赎回费率等相关费率。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：

1）申购费用适用比例费率的情形下：

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/T 日该类基金份额净值

2）申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-固定金额

申购份额=净申购金额/T 日该类基金份额净值

上述计算结果按照四舍五入方法，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。

例：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人（非特定投资群体）本次申购本基金 A 类基金份额 40 万元，对应的本次申购费率为 1.20%，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额=400,000/（1+1.20%）＝395,256.92 元

申购费用=400,000-395,256.92＝4,743.08 元

申购份额=395,256.92/1.0560＝374,296.33 份

即：投资人（非特定投资群体）投资 40 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日基金份额净值为 1.0560 元，可得到 374,296.33 份基金份额。

例：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人（特定投资群体）在直销中心申购本基金 A 类基金份额 40 万元，对应的本次申购费率为 0.48%，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额=400,000/（1+0.48%）＝398,089.17 元

申购费用=400,000-398,089.17＝1,910.83 元

申购份额=398,089.17/1.0560＝376,978.38 份

即：投资人（特定投资群体）投资 40 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日基金份额净值为 1.0560 元，可得到 376,978.38 份基金份额。

例：假定 T 日 I 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人在申购本基金 I 类基金份额 40 万元，对应的本次申购费率为 0.60%，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额=400,000/（1+0.60%）＝397,614.31 元

申购费用=400,000-397,614.31＝2,385.69 元

申购份额=397,614.31/1.0560＝376,528.70 份

即：投资人投资 40 万元申购本基金 I 类基金份额，假定申购当日基金份额净值为 1.0560 元，可得到 376,528.70 份基金份额。

2、 赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500×0%=0.00 元

净赎回金额=12,500-0=12,500.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500 元。

3、本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同约定公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

八、申购与赎回的登记业务

投资人申购基金成功后，在正常情况下，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金成功后，在正常情况下，基金登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理

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。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

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、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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%集中度的情形时。

9、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、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受赎回申请。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，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，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或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类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。

（3）本基金发生巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，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该类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）；对于该基金份额持有人申请赎回的份额中未超过上一开放日基金总份额 10%的部分，基金管理人根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（4）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，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

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，基金管理人应在规定期限内在指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指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

3、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。

十三、基金转换

1、基金转换的办理时间

本基金已于 2015 年 10 月 15 日开通转换转入、转换转出业务。

投资人在开放日办理 A 类基金基金份额的日常转换和定期定额投资业务，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。开放日对投资者的业务办理时间是 9：30-15：00，具体以销售网点的公告和安排为准。

2、日常转换业务

（1）转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成，其中：申购费补差具体收取情况，视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

（2）其他与转换相关的事项

1）、业务规则

①基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的基金。

②前端收费模式的开放式基金只能转换到前端收费模式的其它基金（申购费为零的基金视同为前端收费模式），后端收费模式的基金可以转换到前端或后端收费模式的其它基金，非 QDII 基金不能与 QDII 基金进行互转。

③基金转换的目标基金份额按新交易计算持有时间。基金转出视为赎回，转入视为申购。基金转换后可赎回的时间为 T＋2 日。

④基金分红时再投资的份额可在权益登记日的 T＋2 日提交基金转换申请。

⑤基金转换以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用“份额转换”的原则提交申请。转出基金份额必须是可用份额，并遵循“先进先出”的原则。

4）暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此有关转出基金和转入基金暂停或拒绝申购、暂停赎回的有关规定适用于基金转换。

出现法律、法规、规章规定的其它情形或其它在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形时，基金管理人可以暂停基金转换业务。

5）重要提示

①本基金转换业务适用于可以销售包括博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 A 类基金份额在内的两只以上（含两只），且基金注册登记机构为同一机构的博时旗下基金的销售机构。

②转换业务的收费计算公式及举例参见 2010 年 3 月 16 日刊登于本公司网站的《博时基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务的公告》。

③本公司管理基金的转换业务的解释权归本公司。

十四、基金份额的转让

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

十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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。

十七、定期定额投资计划

本基金已于 2015 年 10 月 15 日开通定期定额投资业务。

（1）适用投资者范围

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会规定允许购买证券投资基金的其他投资者。

（2）申购费率

本基金对通过直销中心申购 A 类基金份额的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。非特定投资群体指除特定投资群体外的其他投资者。

对于申购本基金 A　类基金份额的特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额的特定投资群体	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	0.48%
100 万元≤　M＜500 万元	0.32%
500 万元≤　M＜1000 万元	0.12%
M　≥　1000 万元	1000 元/笔

对于申购本基金 A　类基金份额的非特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的非特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	1.20%
100 万元≤　M＜500 万元	0.80%
500 万元≤　M＜1000 万元	0.30%
M　≥　1000 万元	1000 元/笔

本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（3）扣款日期和扣款金额

投资者须遵循各销售机构有关扣款日期的规定，并与销售机构约定每月扣款金额，但最低每次不少于人民币 10.00 元（含 10.00 元）。

（4）重要提示

1）凡申请办理本基金 A 类基金份额“定期定额投资计划”的投资者须首先开立本公司开放式基金基金账户。

2）本基金 A 类基金份额定期定额投资计划的每月实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日（T 日）的基金份额净值为基准计算申购份额。投资者可以从 T+2 日起通过本定期定额投资计划办理网点、致电本公司客服电话或登录本公司网站查询其每次申购申请的确认情况。申购份额将在确认成功后直接计入投资者的基金账户。

十八、基金份额的冻结和解冻与质押

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。

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

第八部分　基金的投资

一、投资目标

本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 6%，实现对中证淘金大数据 100 指数的有效跟踪。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证淘金大数据 100 指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会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

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证淘金大数据 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。

（一）资产配置策略

本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，标的指数成份股及其备选成份股的投资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合约需缴纳的交

易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（二）股票投资策略

1、股票组合构建原则

本基金采用完全复制法跟踪中证淘金大数据 100 指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

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。

3、股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的中证淘金大数据 100 指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

根据指数编制规则，当中证淘金大数据 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重重新调整时，本基金将进行相应调整。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其它调整

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 6%。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。

4、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

（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）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券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。并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。

（五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于提高基金资产的投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。

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。

四、投资管理程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合，构成了本基金的投资管理程序。

1、研究支持。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果，开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

2、投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

3、组合构建。根据标的指数情况，结合研究报告，基金经理做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整等决策，构建以标的指数成份股为主的投资组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

4、交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。

5、投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

6、组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

7、当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行调整。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

（11）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；

（12)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（13）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（14）本基金参与股指期货投资的，应遵循下列限制：

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

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

4）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规定；

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%；

（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15% ；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（16）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；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（15）、（16）项以外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，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、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

六、业绩比较基准

本基金的标的指数为：中证淘金大数据 100 指数。

本基金业绩比较基准为：95%×中证淘金大数据 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

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以及法律法规、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，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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

七、风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

八、基金的融资、融券及转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和监管部门的有关规定进行融资、融券以及转融通等相关业务。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在

不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会。

九、基金投资组合报告

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

基金托管人根据基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2026 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	229,039,893.09	91.81
	其中：股票	229,039,893.09	91.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,171,949.29	4.48
	其中：债券	11,171,949.29	4.48
	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	7,232,508.13	2.90
8	其他资产	2,019,141.88	0.81
9	合计	249,463,492.39	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,503,508.00	0.61
B	采矿业	5,023,249.70	2.03
C	制造业	172,259,503.35	69.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,799,410.60	0.73
E	建筑业	3,554,676.00	1.44

F	批发和零售业	7,031,670.00	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,026,716.46	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,891,386.58	6.03
J	金融业	11,262,955.40	4.56
K	房地产业	1,737,075.00	0.70
L	租赁和商务服务业	1,673,216.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	2,566,800.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	3,709,726.00	1.50
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	229,039,893.09	92.77

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688766	普冉股份	6,200	4,752,920.00	1.93
2	301308	江波龙	5,700	4,011,660.00	1.62
3	300223	北京君正	16,000	3,982,400.00	1.61
4	688525	佰维存储	7,400	3,661,002.00	1.48
5	001309	德明利	3,800	3,583,020.00	1.45
6	300475	香农芯创	11,500	3,450,000.00	1.40
7	603061	金海通	6,800	3,415,096.00	1.38
8	603986	兆易创新	4,100	3,341,500.00	1.35
9	688498	源杰科技	1,730	3,262,780.00	1.32
10	301536	星宸科技	25,200	3,243,492.00	1.31

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	11,171,949.29	4.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	11,171,949.29	4.53

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	111,000	11,171,949.29	4.53

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2609	IC2609	2.00	3,504,560.00	321,320.00	-
公允价值变动总额合计(元)					321,320.00
股指期货投资本期收益(元)					27,137.95
股指期货投资本期公允价值变动(元)					578,320.00

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	455,171.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,563,970.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,019,141.88

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第九部分 基金的业绩

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

历史各时间段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：

博时中证淘金大数据 100A

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2015.05.04-2015.12.31	-14.49%	3.45%	21.68%	3.39%	-36.17%	0.06%
2016.01.01-2016.12.31	2.35%	1.84%	2.31%	1.78%	0.04%	0.06%
2017.01.01-2017.12.31	12.44%	0.90%	14.13%	0.90%	-1.69%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-28.39%	1.48%	-26.91%	1.46%	-1.48%	0.02%
2019.01.01-2019.12.31	35.32%	1.36%	33.38%	1.38%	1.94%	-0.02%
2020.01.01-2020.12.31	20.32%	1.70%	16.55%	1.70%	3.77%	0.00%
2021.01.01-2021.12.31	-2.26%	1.22%	-8.36%	1.23%	6.10%	-0.01%
2022.01.01-2022.12.31	-19.71%	1.48%	-20.10%	1.54%	0.39%	-0.06%
2023.01.01-2023.12.31	-0.10%	0.78%	-1.61%	0.80%	1.51%	-0.02%
2024.01.01-2024.12.31	10.75%	1.65%	6.92%	1.68%	3.83%	-0.03%
2025.01.01-2025.12.31	30.74%	1.17%	27.29%	1.18%	3.45%	-0.01%
2026.01.01-2026.06.30	24.13%	1.53%	22.19%	1.54%	1.94%	-0.01%
2015.05.04-2026.06.30	61.67%	1.60%	93.39%	1.60%	-31.72%	0.00%

博时中证淘金大数据 100C

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2023.09.13-2023.12.31	-5.73%	0.76%	-6.09%	0.77%	0.36%	-0.01%
2024.01.01-2024.12.31	10.43%	1.65%	6.92%	1.68%	3.51%	-0.03%
2025.01.01-2025.12.31	30.36%	1.17%	27.29%	1.18%	3.07%	-0.01%
2026.01.01-2026.06.30	23.95%	1.53%	22.19%	1.54%	1.76%	-0.01%
2023.09.13-2026.06.30	68.21%	1.39%	56.18%	1.41%	12.03%	-0.02%

博时中证淘金大数据 100I

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

2015.05.04-2015.12.31	-14.47%	3.45%	21.68%	3.39%	-36.15%	0.06%
2016.01.01-2016.12.31	2.36%	1.84%	2.31%	1.78%	0.05%	0.06%
2017.01.01-2017.12.31	12.44%	0.90%	14.13%	0.90%	-1.69%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-28.39%	1.48%	-26.91%	1.46%	-1.48%	0.02%
2019.01.01-2019.12.31	35.32%	1.36%	33.38%	1.38%	1.94%	-0.02%
2020.01.01-2020.12.31	20.33%	1.70%	16.55%	1.70%	3.78%	0.00%
2021.01.01-2021.12.31	-2.27%	1.22%	-8.36%	1.23%	6.09%	-0.01%
2022.01.01-2022.12.31	-19.71%	1.48%	-20.10%	1.54%	0.39%	-0.06%
2023.01.01-2023.12.31	-0.10%	0.78%	-1.61%	0.80%	1.51%	-0.02%
2024.01.01-2024.12.31	10.75%	1.65%	6.92%	1.68%	3.83%	-0.03%
2025.01.01-2025.12.31	30.75%	1.17%	27.29%	1.18%	3.46%	-0.01%
2026.01.01-2026.06.30	24.12%	1.53%	22.19%	1.54%	1.93%	-0.01%
2015.05.04-2026.06.30	61.72%	1.60%	93.39%	1.60%	-31.67%	0.00%

第十部分　基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十一部分　基金资产的估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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、股指期货合约、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市的债券，采用估值技术确定公允价值。对在交易所市场上市交易的不含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；对在交易所市场上市交易的含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

第三方估值机构应根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

6、中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

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

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

四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的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，由基金管理人按约定对外公布。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任何一类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，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其

支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额

的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按约定予以公布。

八、特殊情况的处理

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

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十二部分　基金的收益分配

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、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，且基金份额持有人可对 A 类、C 类和 I 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、由于本基金 A 类、I 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

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，不足于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。

第十三部分　基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（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、C 类基金份额的销售服务费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、证券、期货账户开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60　%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

本基金 A 类、I 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年费率为 0.30%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30%年费率计提。 计算方法如下：

H=E×0.30%÷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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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。

二、与基金销售有关的费用

1、A 类和 I 类基金份额的申购费和赎回费

本基金对通过直销中心申购 A 类基金份额的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

对于申购本基金 A 类基金份额的特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额的特定投资群体	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	0.48%
100 万元≤ M＜500 万元	0.32%

500 万元≤ M＜1000 万元	0.12%
M ≥ 1000 万元	1000 元/笔

对于申购本基金 A 类基金份额的非特定投资群体，本基金申购费率如下表所示：

表：A 类基金份额的非特定投资群体的申购费率表

A 类基金份额	
申购金额（M）	申购费率
M＜100 万元	1.20%
100 万元≤ M＜500 万元	0.80%
500 万元≤ M＜1000 万元	0.30%
M ≥ 1000 万元	1000 元/笔

A 类基金份额赎回费率：

表：A 类基金份额的赎回费率表

持有基金份额期限（Y）	赎回费率
Y＜7 日	1.50%
7 日≤Y＜3 个月	0.30%
Y≥3 个月	0

I 类基金份额申购费率：

表：I 类基金份额的申购费率表

申购金额（M）	申购费率（%）
M＜100 万元	0.60%
100 万元≤M＜500 万元	0.40%
500 万元≤M＜1000 万元	0.30%
M≥1000 万元	1000 元/笔

I 类基金份额赎回费：

表：I 类基金份额的赎回费率表

持有基金份额期限（Y）	赎回费率（%）
Y＜7 日	1.50%
7 日≤Y＜3 个月	0.30%
Y≥3 个月	0

赎回费用由赎回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。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者将不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

2、C 类基金份额的申购费与赎回费

（1）本基金 C 类基金份额不收取申购费。

（2）本基金 C 类基金份额赎回费率随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示：

持有基金份额期限（Y）	C 类基金份额的赎回费率
Y＜7 日	1.50%
Y≥7 日	0

赎回费用由赎回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。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

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。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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》、基金合同及其他有关规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

5、基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

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

（四）基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的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，通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

（五）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营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

（七）临时报告

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

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、基金合同终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、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；

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

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

14、基金收益分配事项；

15、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；

16、任何一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、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；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、调整本基金份额类别设置；

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时；

23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（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的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十）清算报告

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

（十一）投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（十二）投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报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。

（十三）基金跟踪指数情况的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告里披露基金管理人严格跟踪指数情况，包括跟踪误差、严格复制跟踪的执行等情况。

（十四）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、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、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指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指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

第十六部分　风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

1．市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

（2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

（3）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跌的风险。

2．指数化投资风险

本基金的主要投资标的为标的指数中证淘金大数据 100 指数的成份股。本基金的资产净值会随标的指数的波动而波动。

3．跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

（1）基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

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

（3）当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时

扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（4）投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遇到标的指数成份股停牌、摘牌或流动性较差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（5）在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

（6）其他因素产生的偏离。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较高；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度和跟踪误差。

4．投资标的过分集中的风险

本基金对标的指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。

5．巨额申购赎回所隐含的风险

在巨额申购发生时，可能会出现在短期内对标的指数成份股的投资比例被迫处于较低水平的状况，从而导致跟踪误差的大幅增加；在巨额赎回发生时，可能会出现在短期内被迫卖出大量的标的指数成份股，这种流动性买卖压力也可能导致跟踪误差的大幅增加。

6．流动性风险

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

基于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应对基金赎回，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的风险。

（1）基金申购、赎回安排

本基金在客户集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响，以及市场大幅波动、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，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

（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交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

（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。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。

7. 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向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

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

8、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 6%，实现对中证淘金大数据 100 指数的有效跟踪。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。

9、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，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

（1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

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

10、成份股退市的风险

标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

11、操作或技术风险

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

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记结算机构、销售机构、证券交易所等。

12、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险。例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险；相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险。

13、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

14、本基金的特有风险

（1）本基金与传统指数基金存在差异

本基金与传统指数基金的主要差异是跟踪标的指数的不同。

本基金的标的指数属于策略指数，与传统指数主要区别在于两点：一是选股策略，标的指数采用量化模型进行选股，不仅使用财务指标和市场驱动指标，还通过大数据因子来衡量样本股所在行业景气度，共同形成选股机制；二是加权方式，区别于传统指数，标的指数采用等权重的加权方式。

（2）基金管理人主动量化选股模型存在失效导致基金表现不佳的风险

本基金为策略指数基金，所跟踪的标的指数为策略指数。基金管理人通过主动量化选股模型确定指数编制策略。标的指数因子模型和优化模型的构建与计算是由基金管理人采用量化投资策略确定的。因此，本基金存在基金管理人主动量化选股模型失效导致基金表现不佳的风险。当基金管理人主动量化选股模型失效时，本基金的业绩表现可能受到影响。并且，指数的历史业绩仅能代表过去选股策略的结果，并不能代表指数和本基金未来的表现。

（3）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；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。

二、声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他销售机构进行销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

第十七部分　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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十八部分　基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）、基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

（3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，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与赎回申请；

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

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和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，确定各类基金份额申购、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，不向他人泄露；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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。

（二）、基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、各类基金份额申购、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的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）、基金份额持有人

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。

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）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

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

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9） 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（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：

（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）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

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

（1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费率和其他应由基金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内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调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别设置；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

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

（6）若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改基金合同；

（7）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（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，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（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在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（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书面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按规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

（二）、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）、清算费用

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

（五）、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的各类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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

五、基金合同的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。

第十九部分　基金托管协议的内容摘要

一、　托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：博时基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

邮政编码：518040

法定代表人：张东

成立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；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(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：张金良

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟陆佰壹拾陆亿零叁拾捌万壹仟肆佰伍拾玖元整

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提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证淘金大数据 100 指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会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. 本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；

2. 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3. 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

4.本基金管理人管理的且本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

6.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%；

7.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%；

8.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%；

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

10.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；

11.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；

12.本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

13. 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

14 本基金参与股指期货投资的，应遵循下列限制：

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

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

4）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；

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%。

15 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15% ；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

16.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；

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

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

除上述第 2、10、15、16 项以外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

（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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，

新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

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

（七）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。

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

（九）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、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人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、证券账户、期货账户所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、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、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2.基金托管人应安全保管基金财产。

3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货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，确保基金财产的完整与独立。

5.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何

资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

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

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

（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基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

（三）基金银行账户的开立和管理

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

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

3.基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

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

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

（五）债券托管专户的开设和管理

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

（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，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

五、基金资产净值计算与复核

（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负债后的金额。各类基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

（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、股指期货合约、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2.估值方法

(1)证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市的债券，采用估值技术确定公允价值。对在交易所市场上市交易的不含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；对在交易所市场上市交易的含权债券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值；

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

(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(3)全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4)本基金转为 ETF 联接基金后，本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

(5)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

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

3.特殊情形的处理

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

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施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

1.当任何一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

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

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

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

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

4.前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1.基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3.当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，应当暂停估值；

4.法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存

在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（七）基金财务报表与报告的编制和复核

1.财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2.报表复核

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

3.财务报表的编制与复核时间安排

(1)报表的编制

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

(2)报表的复核

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

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）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，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本协议受中国法律管辖。

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。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

（二）基金托管协议终止出现的情形

1.《基金合同》终止；

2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4.发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4.基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)将清算结果报中国证监会备案并公告；

(7)对基金剩余财产进行分配。

5.基金财产清算的期限为 6 个月。

6.清算费用

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

7.基金财产清算剩余资产的分配：

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

8.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计、并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

9.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十部分　对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、基金销售机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目，主要服务内容如下：

一、持有人交易资料的寄送服务

1、交易确认单

基金合同生效后正常开放期，每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过博时一线通电话、博时网站查询交易确认情况。基金管理人不向投资者寄送交易确认单。

2、电子对账单

每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（https://www.bosera.com）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 service@bosera.com；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

由于投资者提供的电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本基金管理人网站，或拨打博时一线通客服电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

二、网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

1、自助开户交易

投资者可登录基金管理人网站网上交易系统，与本公司达成电子交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可自助开户并进行网上交易，如基金认/申购、定投、转换、赎回、赎回转申购及分红方式变更等。具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

2、查询服务

投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改基金账户信息等基本资料。

3、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

4、在线客服

投资者可以通过基金管理人网站首页“在线客服”功能进行在线咨询。也可以在“您问我答”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

三、短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

四、电子邮件服务

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

五、手机理财服务

投资者通过博时 App 版直销网上交易系统，可以使用基金理财所需的基金交易、理财查询、账户管理、信息资讯等功能和服务。

六、信息订阅服务

投资者可以通过基金管理人网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

七、电话理财服务

投资者拨打博时一线通：95105568（免长途话费）可享有投资理财交易的一站式综合服务：

1、自助语音服务：基金管理人自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息，也可以进行直销交易、密码修改、传真索取等操作。

2、电话交易服务：本公司直销投资者可通过博时一线通电话交易平台在线办理基金的赎回、变更分红方式、撤单等直销交易业务。

3、人工电话服务：投资者可以获得业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制等服务。

4、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

八、基金管理人联系方式

公司网址：https://www.bosera.com

电子信箱：service@bosera.com

博时一线通客服电话：95105568（免长途话费）

九、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十一部分 其他应披露的事项

（一）、2026 年 8 月 31 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2026 年中期报告》；

（二）、2026 年 7 月 21 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下混合基金的公告》、《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告》；

（三）、2026 年 7 月 20 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下权益类公募基金的公告》；

（四）、2026 年 7 月 14 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告》；

（五）、2026 年 6 月 26 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金（博时中证淘金大数据 100A）基金产品资料概要更新》、《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金（博时中证淘金大数据 100I）基金产品资料概要更新》、《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金（博时中证淘金大数据 100C）基金产品资料概要更新》；

（六）、2026 年 5 月 29 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告》；

（七）、2026 年 5 月 13 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（八）、2026 年 4 月 30 日，我公司公告了《2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露》；

（九）、2026 年 4 月 24 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十）、2026 年 4 月 22 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》；

（十一）、2026 年 3 月 31 日，我公司公告了《博时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）》、《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2025 年年度报告》；

（十二）、2026 年 2 月 26 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告》；

（十三）、2026 年 2 月 14 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；

（十四）、2026 年 1 月 24 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20260124》；

（十五）、2026 年 1 月 22 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》；

（十六）、2025 年 12 月 31 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告》；

（十七）、2025 年 12 月 18 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十八）、2025 年 12 月 6 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》；

（十九）、2025 年 11 月 13 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（二十）、2025 年 11 月 12 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；

（二十一）、2025 年 10 月 28 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》；

（二十二）、2025 年 10 月 17 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（二十三）、2025 年 10 月 16 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；

（二十四）、2025 年 9 月 30 日，我公司公告了《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金更新招募说明书》；

（二十五）、2025 年 9 月 4 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告》。

第二十二部分　招募说明书存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，以供公众查阅、复制；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（https://www.bosera.com）查阅和下载招募说明书。

第二十三部分　备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金募集注册的文件

（二）《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》

（三）《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金的法律意见书

（七）中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

博时基金管理有限公司

2026 年 9 月 30 日