

# 广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证 券投资基金更新的招募说明书

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

时间：二〇二四年五月

## 【重要提示】

1、本基金于 2019 年 11 月 19 日经中国证监会证监许可[2019]2410 号文准予募集注册。

2、本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

3、本基金的标的指数为上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数。上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数在 AAA 评级中央国有企业发行人范围内，参考投资级公司标准，选择符合样本券要求的存续债券规模排名前 80 的发行人，跟踪其所发行的待偿期 4 年以内的短期融资券、中期票据、企业债等的价格走势，可作为投资该类债券的业绩比较基准和标的指数。样本选取方法如下：

1) 流通场所：银行间市场、上交所、深交所

2) 债券品种：

短期融资券、超短期融资券、绿色债务融资工具、中期票据、企业债、公司债等

3) 主体评级：AAA

4) 发行方式：公募

5) 剩余期限：0.25-4 年（含）

6) 债券币种：人民币

7) 利率类型：固定利率

8) 付息方式：付息式固定利率、贴现式、利随本清

9) 含权情况：包括含选择权条款债券

10) 永续债：不包含永续债

11) 发行人性质：注册地在中国大陆,并且为非校企的中央国有企业

12) 其他条件：发行人参考《商业银行资本管理办法》及附件《信用风险权重法风险暴露分类标准》中对投资级公司的要求进行筛选，选择符合样本券要求的存续债券规模排名前 80 的主体进入指数

以上标的指数编制方案自 2024 年 6 月 3 日起实施。有关标的指数信息详见上海清算所网站，网址：

<https://www.shclearing.com.cn/cpgz/zqjqysp/zqzs/bzsm/>

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险，本基金的特定风险等。

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金是指数基金，其特定风险包括指数化投资相关的风险、标的指数的风险、基金跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌或违约的风险等。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以 1.00 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1.00 元初始面值的风险。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》《基金产品资料概要》及《基金合同》。

5、本次更新的招募说明书主要对本基金标的指数编制方案、基金管理人、基金托管人等信息进行修订，更新内容截止日为 2024 年 5 月 23 日。除非另有说明，本招募说明书(更新)其他所载内容截止日为 2024 年 1 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 3 月 31 日（本报告中财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分	绪言	1
第二部分	释义	2
第三部分	基金管理人	7
第四部分	基金托管人	15
第五部分	相关服务机构	19
第六部分	基金的募集	21
第七部分	基金合同的生效	22
第八部分	基金份额的申购、赎回与转换	23
第九部分	基金的投资	36
第十部分	基金的业绩	44
第十一部分	基金的财产	47
第十二部分	基金资产的估值	48
第十三部分	基金的收益与分配	53
第十四部分	基金费用与税收	55
第十五部分	基金的会计与审计	59
第十六部分	基金的信息披露	60
第十七部分	侧袋机制	66
第十八部分	风险揭示	68
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	74
第二十部分	基金合同的内容摘要	76
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要	92

第二十二部分	对基金份额持有人的服务 .....	107
第二十三部分	其他应披露事项 .....	109
第二十四部分	招募说明书存放及查阅方式 .....	111
第二十五部分	备查文件 .....	112

## 第一部分 绪言

《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）以及《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金（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，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

1、招募说明书或本招募说明书：指《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金招募说明书》及其更新

2、基金或本基金：指广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金

3、基金管理人：指广发基金管理有限公司

4、基金托管人：指交通银行股份有限公司

5、基金合同：指《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

7、基金份额发售公告：指《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数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，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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/或国家金融监督管理总局

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、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

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

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。基金的登记机构为广发基金管理有限公司或接受广发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《广发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 and 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的基金份额的行为

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：指计算日各类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额的余额总数

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、基金份额类别：本基金将基金份额分为 A 类、C 类和 D 类三种不同的类别。在投资者申购 A 类及 D 类基金份额时收取申购费用，不计提销售服务费；在投资者申购 C 类基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费

53、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

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

55、规定媒介：指中国证监会规定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定互联网网站（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

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

57、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

58、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

59、基金产品资料概要：指《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数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、概况

- 1、名称：广发基金管理有限公司
- 2、住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室
- 3、办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室
- 4、法定代表人：葛长伟
- 5、成立时间：2003 年 8 月 5 日
- 6、电话：020-83936666  
全国统一客服热线：95105828
- 7、联系人：程才良
- 8、注册资本：14,097.8 万元人民币
- 9、股权结构：

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
总计	100%

#### 二、主要人员情况

##### 1、董事会成员

葛长伟先生：董事长，学士，曾在安徽省人大财经委、安徽省财政厅、安徽省政府办公厅、安徽省计委、中国神华集团运销公司、国家发展和改革委员会、国务院办公厅、重庆市委、广东省委、广东省清远市委、广东省发展和改革委员会、中国南方电网有限责任公司、广发证券股份有限公司工作。

孙晓燕女士：董事，硕士，现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理、财务总监，兼任证通股份有限公司监事。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、广发证券股份有限公司投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司财务部总经理，证通股份有限公司监事会主席。

王凡先生：董事，博士，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事会主席、广州投资顾问学院管理有限公司董事。曾在财政部、易方达基金管理有限公司工作，曾任广发基金管理有限公司副总经理。

曾军先生：董事，硕士，正高级工程师，现任烽火通信科技股份有限公司董事长，兼任烽火超微信息科技有限公司董事长。曾任武汉邮电科学研究院研究员，烽火通信科技股份有限公司经理、哈尔滨办事处主任、国内市场总部副总经理、客户服务中心总经理，武汉烽火技术服务有限公司总经理，烽火通信科技股份有限公司副总裁、总裁。

刘根森先生：董事，学士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事，兼任香江集团有限公司副总裁，深圳香江控股股份有限公司董事，深圳市大本创业投资有限公司董事。曾任德意志银行香港分行分析员，深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长，深圳市龙岗中银富登村镇银行董事。

张彦先生：董事，学士，现任广州科技金融创新投资控股有限公司董事长，兼任广州产业投资基金管理有限公司助理总经理、广州南沙资讯科技园有限公司副董事长。曾任珠海证券、珠证恒隆实业业务经理，金汇来发展有限公司副总经理，第一证券营业部副总经理，广发证券营业部总经理，齐鲁证券营业部总经理，中泰证券广东分公司总经理，广州市工业转型升级发展基金管理有限公司常务副总经理，广州市城发投资基金管理有限公司董事长，广州广泰城发规划咨询有限公司董事长，广州科技金融创新投资控股有限公司副总经理，广州汇垠天粤股权投资基金管理有限公司董事长，广州基金国际股权投资基金管理有限公司董事长，上海鹏欣（集团）有限公司副总裁，黑龙江国中水务股份有限公司董事长。

罗海平先生：独立董事，博士，教授、高级经济师，现任北京平智云数字科技合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人。曾任中国人民保险公司荆襄支公司经理，长江保险经纪公司总经理，中国人民保险公司湖北省分公司国际保险部党组书记、总经理，中国人民保险公司汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理，中国太平保险有限公司湖北分公司党委书记、总经理，中国太平保险有限公司助理总经理、副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总裁、阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记，中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、首席风险官。

董茂云先生：独立董事，博士，教授，现任浙大城市学院法学院教授，兼任浙江合创律师事务所兼职律师，江苏恒顺醋业股份有限公司董事（外部董事）。曾任复旦大学法学院副教授、法律系副主任、法学院副院长、法学院教授，宁波大学法学院教授。

姚海鑫先生：独立董事，博士，教授，现任辽宁大学新华国际商学院教授，兼任东软医疗股份有限公司独立董事，辽宁金融控股集团有限公司外部兼职董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任，辽宁大学发展规划处处长、财务处处长，辽宁大学学术委员会委员。

## 2、监事会成员

符兵先生：监事会主席，硕士，中级经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司市场拓展部副总经理、广州分公司总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

吴晓辉先生：职工监事，硕士，工程师，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理。曾任广发证券股份有限公司信息技术部副经理、经理，广发基金管理有限公司运营保障部副总经理。

孔伟英女士：职工监事，学士，经济师，现任广发基金管理有限公司人力资源部总经理。曾任职于广发证券股份有限公司。

刘敏女士：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理，营销服务部总经理助理，产品营销管理部总经理助理。

喻晨女士：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司合规稽核部总经理。曾任职于广发基金管理有限公司市场拓展部、金融工程部、产品营销管理部。

### 3、总经理及其他高级管理人员

王凡先生：总经理，博士，兼任广发国际资产管理有限公司董事会主席、广州投资顾问学院管理有限公司董事。曾在财政部、易方达基金管理有限公司工作，曾任广发基金管理有限公司副总经理。

朱平先生：副总经理，硕士，经济师，兼任瑞元资本管理有限公司董事。曾任上海荣臣集团市场部经理，广发证券有限责任公司投资银行部华南业务部副总经理，基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士：副总经理，硕士。曾任中国农业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

张芊女士：副总经理，硕士，兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理、基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国人保资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理。

程才良先生：督察长，博士，副教授。曾在辽河石油勘探局研究院、重庆商学院、广东民族学院、广东证监局、厦门证监局、珠海金融投资控股集团有限公司工作。

傅友兴先生：副总经理，硕士，兼任广发基金管理有限公司联席投资总监、价值投资部总经理、基金经理。曾在原天同基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司研究员、机构理财部副总经理、规划发展部总经理、研究发展部总经理、权益投资一部副总经理。

刘格菘先生：副总经理，博士，兼任广发基金管理有限公司联席投资总监、成长投资部总经理、基金经理。曾在中国人民银行、中邮创业基金管理有限公司、融通基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理、北京权益投资部总经理。

王海涛先生：副总经理，硕士，兼任广发基金管理有限公司基金经理、广发国际资产管理有限公司副董事长。曾在美国 Business Excellence Inc.、摩根士丹利亚洲有限公司、兴全基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司专户投资部总经理、公司总经理助理。

窦刚先生：副总经理、首席信息官，硕士，工程师。曾在广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司中央交易部总经理、运营总监、公司总经理助理。

### 4、基金经理

洪志先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。现任广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 1 月 27 日起任职)、广发汇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 27 日起任职)、广发均衡增长混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 27 日起任职)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 10 月 14 日起任职)、广发景辉纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 10 月 25 日起任职)、广发景宏债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 5 月 11 日起任职)、广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 7 月 11 日起任职)、广发中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 7 月 11 日起任职)、广发政策性金融债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 11 月 3 日起任职)、广发添福 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 10 月 24 日起任职)、广发汇阳三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 26 日起任职)、广发民玉纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 26 日起任职)、广发汇明一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2024 年 2 月 29 日起任职)。曾任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易兼研究员、投资经理，广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2020 年 2 月 11 日)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 1 月 27 日)、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 4 月 8 日)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 9 月 22 日)、广发汇宏 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)、广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 21 日至 2021 年 10 月 25 日)、广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 1 月 10 日至 2022 年 7 月 11 日)、广发汇吉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 4 月 10 日至 2023 年 1 月 10 日)、广发民玉纯债债券型证券投资基金基金经理助理(自 2023 年 5 月 25 日至 2023 年 12 月 26 日)、广发汇阳三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理(自 2023 年 11 月 1 日至 2023 年 12 月 26 日)、广发汇荣三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 16 日至 2024 年 4 月 25 日)。

历任基金经理：李伟，任职时间为 2020 年 4 月 29 日至 2022 年 7 月 11 日。



5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

基金管理人固定收益投资决策委员会由副总经理张芊女士、固定收益投资总监温秀娟女士、混合资产投资副总监曾刚先生、混合资产投资部联席总经理姚秋先生、债券投资部总经理宋倩倩女士、固定收益研究部副总经理葛飞先生、宏观策略部总经理武幼辉先生、金融工程与风险管理部总经理高詹清先生等成员组成，张芊女士担任固定收益投资决策委员会主席。

6、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、依法募集基金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺：

(1) 严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他法律法规行为的发生；

(2) 根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

2、基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定，基金资产不得用于下列投资或者活动：

- (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) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、基金经理承诺：

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责。

2、建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督的责任。

3、建立以合规管理部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。合规管理部门属于内核部门，独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和监督。

4、建立以合规审核委员会及督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的第四道监控防线。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：方圆

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 14 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 161 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2024 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 14.24 万亿元。2024 年一季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 249.9 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

#### （二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生 2020 年 7 月起担任本行行长；2016 年 11 月至 2020 年 5 月任中国投资有限责任公司副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月任中国光大集团股份公司副总经理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014 年 6 月至 2016 年 11 月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009 年 9 月至 2014 年 6 月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993 年 7 月至 2009 年 9 月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生 2003 年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任本行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年 4 月任本行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2024 年 3 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 879 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转地方国有股权充实社保

基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP 等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变

化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

直销机构：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

法定代表人：葛长伟

客服电话：95105828 或 020-83936999

客服传真：020-34281105

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

直销机构网点信息：本公司网上直销系统（仅限个人客户）和直销中心（仅限机构客户）销售本基金，网点具体信息详见本公司网站。

客户可以通过本公司客服电话进行销售相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

#### 2、其他销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增减或变更基金销售机构，并在基金管理人网站公示基金销售机构名录。投资者在各销售机构办理本基金相关业务时，请遵循各销售机构业务规则与操作流程。

### 二、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

法定代表人：葛长伟

联系人：李尔华

电话：020-89188970



传真：020-89899175

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：广东广信君达律师事务所

住所：广东省广州市天河区珠江东路6号周大福金融中心29层、10层、11层（01-04单元）

负责人：邓传远

电话：020-37181333

传真：020-37181388

经办律师：杨琳、刘智

联系人：邓传远

### 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法人代表：毛鞍宁

联系人：冯所腾

电话：010-58152016

传真：010-85188298

经办注册会计师：冯所腾、林亚小

## 第六部分 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 2019 年 11 月 19 日经中国证监会证监许可[2019]2410 号文准予募集注册。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期为不定期。

本基金自 2020 年 4 月 27 日进行发售。本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

本基金的面值为每份基金份额人民币 1.00 元。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金基金合同已于 2020 年 4 月 29 日生效，自该日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《基金合同》生效后，连续二十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 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

### 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。具体的销售机构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。本基金的销售机构包括：

- 1、本公司直销机构；
- 2、其他销售机构：经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所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》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。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；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

### 四、申购与赎回的数额限制

- 1、通过基金销售机构或基金管理人网上交易系统每个基金账户首次最低申购金额为1元（含申购费）人民币；投资人追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构网点公告。
- 2、基金份额持有人在各销售机构的最低赎回、转换转出及最低持有份额为1份基金份额，基金份额持有人当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足1份基金份额时，注册登记机构有权将全部剩余份额自动赎回。各基金销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理上述业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。
- 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、单日申购金额上限以及单日净申购比例上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。
- 4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制，具体规定请参见招募说明书或相关公告。
- 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额的数量限制、总规模限额以及相关比例上限。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 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，申购成立；本基金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；本基金登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，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，投资人可在 T+2 日后(包括该日)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。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不生效，则申购款项退还给投资人。

在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。

## 六、基金份额类别设置

基金将基金份额分为 A 类、C 类和 D 类三种不同的类别。在投资者申购 A 类及 D 类基金份额时收取申购费用，不计提销售服务费；在投资者申购 C 类基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金 A 类、C 类及 D 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为：

计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数

投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

有关基金份额类别的具体设置等由基金管理人确定，并在本招募说明书中公告。根据基金销售情况，在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整前基金管理人需及时公告。

## 七、申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

(1) 本基金 A 类基金份额和 D 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金 A 类基金份额和 D 类基金份额对申购设置级差费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

A 类基金份额	
申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	0.50%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.30%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.15%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元
D 类基金份额	
申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	0.60%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.40%
200 万元 ≤ M < 600 万元	0.20%
M ≥ 600 万元	每笔 1500 元

基金销售机构可以根据自身情况对申购费用实行一定的优惠，具体以实际收取为准。

(2) 本基金 A 类基金份额及 D 类基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3) 本基金可对通过本公司直销中心申购 A 类或 D 类基金份额的特定投资者与除此之外的其他普通投资者实施差别的申购费率，特定投资者范围以及具体费率优惠详见基金管理人发布的相关公告。

## 2、赎回费率

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。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，赎回费至少 25% 计入基金财产，其中对持续持有期少于 7 天的投资者收取 1.50% 的赎回费并全额计入基金财产。具体费率如下：

A 类份额	持有期限 (N 为日历日)	赎回费率
	N < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.10%
	N ≥ 30 天	0
C 类份额	持有期限 (N 为日历日)	赎回费率
	N < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.10%
	N ≥ 30 天	0
D 类份额	持有期限 (N 为日历日)	赎回费率
	N < 7 天	1.50%
	N ≥ 7 天	0

3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》有关规定在规定媒体上公告。

4、对特定交易方式（如网上交易等），在不违背法律法规规定的情况下，基金管理人可以适当调低基金销售服务费率、基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背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，针对基金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，对基金投资者适当调低基金销售服务费率、申购费率、赎回费率和转换费率。



## 八、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、本基金申购份额的计算：

(1) 若投资者选择 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

或，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

或，申购费用 = 固定申购费金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

例 1：某投资人投资 50,000 元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 0.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 50,000 / (1 + 0.50%) = 49,751.24 元

申购费用 = 50,000 - 49,751.24 = 248.76 元

申购份额 = 49,751.24 / 1.0160 = 48,967.76 份

即：投资者投资 50,000 元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 0.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 48,967.76 份 A 类基金份额。

(2) 若投资人选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

例 2：某投资者投资 50,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 = 50,000 / 1.0160 = 49,212.60 份

即：投资者投资 50,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 49,212.60 份 C 类基金份额。

(3) 若投资者选择申购 D 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

或，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

或，申购费用 = 固定申购费金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 D 类基金份额净值

例 3：某投资人投资 50,000 元申购本基金 D 类基金份额，对应费率为 0.60%，假设申购当日 D 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.60\%) = 49,701.79 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,701.79 = 298.21 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,701.79 / 1.0160 = 48,919.08 \text{ 份}$$

即：投资者投资 50,000 元申购本基金 D 类基金份额，对应费率为 0.60%，假设申购当日 D 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 48,919.08 份 D 类基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日该类基金份额的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额的基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{该类基金份额的赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例 1：某投资者赎回 10 万份 A 类基金份额，份额持有期限 15 天，对应赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.2130 = 121,300.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 121,300.00 \times 0.10\% = 121.30 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 121,300.00 - 121.30 = 121,178.70 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额，份额持有期限 15 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的净赎回金额为 121,178.70 元。

例 2：某投资者赎回 10 万份 C 类基金份额，份额持有期限 15 天，对应赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2125 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.2125 = 121,250.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 121,250.00 \times 0.10\% = 121.25 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 121,250.00 - 121.25 = 121,128.75 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10 万份 C 类基金份额，份额持有期限 15 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2125 元，则其可得到的净赎回金额为 121,128.75 元。

例 3：某投资者赎回 10 万份 D 类基金份额，份额持有期限 15 天，对应赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 D 类基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=100,000×1.2130=121,300.00 元

赎回费用=121,300.00×0.00%=0.00 元

净赎回金额=121,300.00—0.00=121,300.00 元

即：投资者赎回本基金 10 万份 D 类基金份额，份额持有期限 15 天，假设赎回当日 D 类基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的净赎回金额为 121,300.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

计算公式为：T 日某类基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值/T 日该类别基金份额的余额总数。

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，并在 T+1 日内披露。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或披露。

### 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额净值，有效份额单位为份，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。

### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。

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

## 九、申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

## 十、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、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。

4、证券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。

5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6、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。

7、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。

8、基金管理人接受某笔或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、4、6、7、9 项暂停申购情形且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，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。

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

4、证券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。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

7、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暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。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。

## 十二、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全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部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。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20% 的，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过该比例以上的赎回申请实施延期办理（基金份额持有人可在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销），对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。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。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者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 日内在规定媒介上刊登公告。

## 十三、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，基金管理人应当在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### **十四、基金的转换**

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

#### **十五、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。

#### **十六、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。

#### **十七、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。

#### **十八、定期定额投资计划**

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

## 十九、基金的冻结、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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或基金合同另有规定的除外。

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。

## 二十、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 二十一、基金份额折算

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。

二十二、当技术条件成熟，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者安排本基金的一类或多类基金份额在证券交易所上市交易、申购或赎回，或者办理基金份额的转让、过户、质押等业务，或者安排本基金的一类或多类基金份额在银行间市场办理协议转让等业务，届时无须召开基金份额持有人大会审议但须提前公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，将年化跟踪误差控制在 2%以内。

### 二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债、可分离交易可转债、可交换债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为债券指数基金，本基金不投资于标的指数成份券发行主体之外的主体发行的信用债券。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、标的指数

本基金的标的指数为上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数（指数代码 SCH00902）。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作

方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

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

#### **四、投资策略**

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，将年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。

#### **五、业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为“上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”。

#### **六、风险收益特征**

本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

#### **七、组合限制**

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；

2、本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

- 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 5、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%，回购期限不得超过 1 年，到期后不得展期；
- 6、本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- 7、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 8、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；
- 9、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、7、8 项规定以外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。上述期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 八、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、依照法律法规有关规定，由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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利

益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须先得到基金托管人同意，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。

## 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

十、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

## 十一、未来条件许可情况下的基金模式转换

若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、基金合同内关于申购与赎回、基金份额持有人大会、收益分配、基金资产估值、基金的会计与审计、信息披露等条款均适用于转换后的基金。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 十二、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### 十三、基金的投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，于2023年6月7日复核了本报告中的财务指标、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2023年3月31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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	2,523,075,074.70	98.94
	其中：债券	2,523,075,074.70	98.94
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	26,697,341.09	1.05
7	其他资产	452,827.56	0.02
8	合计	2,550,225,243.35	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### (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通过港股通投资的股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	242,707,741.12	11.91
	其中：政策性金融债	242,707,741.12	11.91
4	企业债券	578,655,375.89	28.38
5	企业短期融资券	60,058,131.15	2.95
6	中期票据	1,641,653,826.54	80.53
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	2,523,075,074.70	123.77
----	----	------------------	--------

#### 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	102280189	22 中车集 MTN001	1,300,000	130,430,460.27	6.40
2	102101795	21 宝钢 MTN001(可持续 挂钩)	1,200,000	122,131,870.68	5.99
3	101651038	16 华能集 MTN004	1,100,000	113,671,016.44	5.58
4	230201	23 国开 01	1,100,000	110,204,491.80	5.41
5	102281291	22 中交建 MTN001	1,000,000	101,530,246.58	4.98

#### 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

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国交通建设股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### (3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	65,069.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	387,758.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	452,827.56

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。



## 第十部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。基金业绩数据截至 2023 年 3 月 31 日。

### 一、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

#### 1、广发央企 80 债券指数 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2020.04.29-2020.12.31	0.34%	0.04%	0.26%	0.04%	0.08%	0.00%
2021.01.01-2021.12.31	3.95%	0.03%	3.70%	0.02%	0.25%	0.01%
2022.01.01-2022.12.31	2.47%	0.05%	2.39%	0.03%	0.08%	0.02%
2023.01.01-2023.03.31	0.87%	0.04%	0.74%	0.02%	0.13%	0.02%
自基金合同生效起至今	7.81%	0.04%	7.23%	0.03%	0.58%	0.01%

#### 2、广发央企 80 债券指数 C:

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

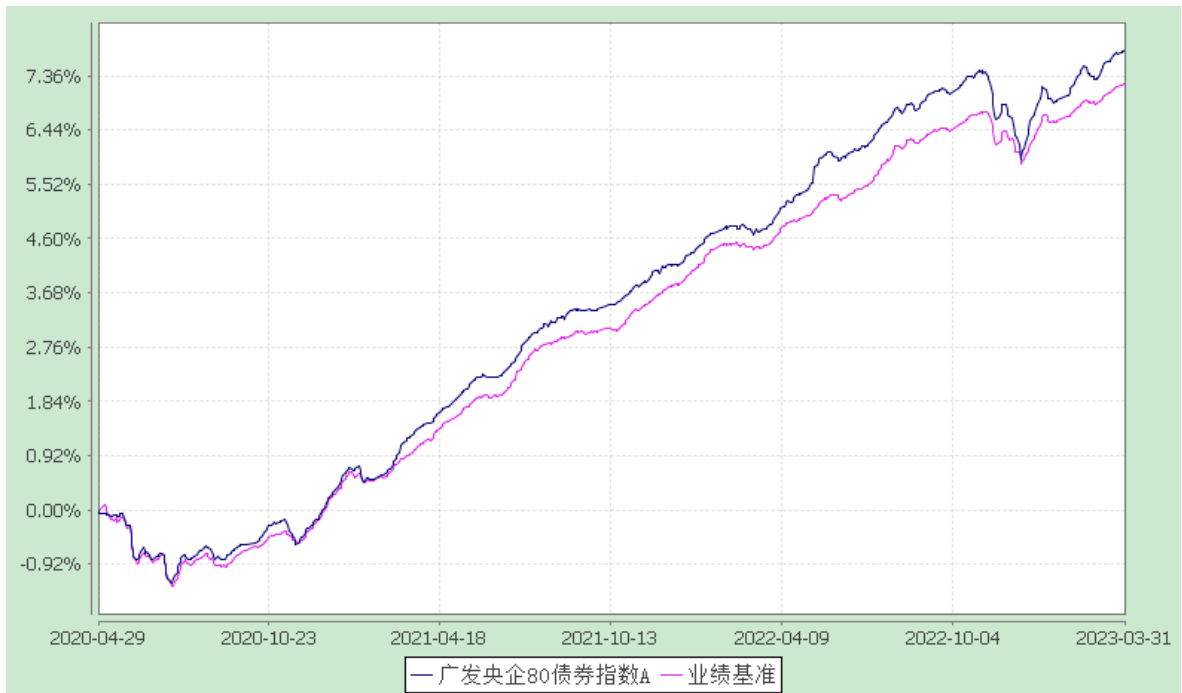
	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
2020. 04. 29-2020. 12. 31	0. 29%	0. 04%	0. 26%	0. 04%	0. 03%	0. 00%
2021. 01. 01-2021. 12. 31	5. 95%	0. 13%	3. 70%	0. 02%	2. 25%	0. 11%
2022. 01. 01-2022. 12. 31	2. 46%	0. 05%	2. 39%	0. 03%	0. 07%	0. 02%
2023. 01. 01-2023. 03. 31	0. 85%	0. 04%	0. 74%	0. 02%	0. 11%	0. 02%
自基金合 同生效起 至今	9. 80%	0. 09%	7. 23%	0. 03%	2. 57%	0. 06%

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

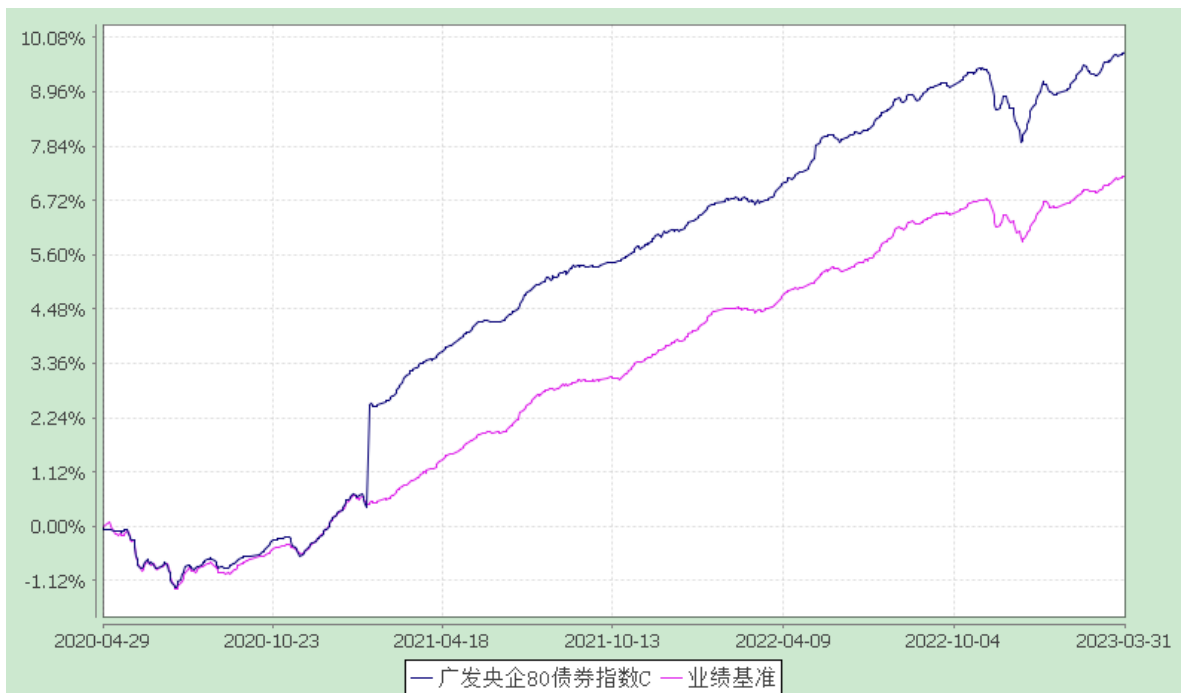
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 4 月 29 日至 2023 年 3 月 31 日)

广发央企 80 债券指数 A



广发央企 80 债券指数 C



## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十二部分 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、估值原则

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

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

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

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

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

### 四、估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

#### 1、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日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进行估值；

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券和私募债券，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；

(5) 首次公开发行未上市的债券，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。

#### 2、全国银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场交易不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，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；

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

3、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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，若估值日为非证券交易所营业日，以该目标 ETF 最近估值日的基金份额净值估值。

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

6、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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权向监管部门报告。由此给基金份额持有人和基金造成损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起损失的，基金托管人不负责赔付。

## 五、估值程序

1、各类基金份额的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总数计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定披露。

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，由基金管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任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) 任一类基金份额净值计算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，并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类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净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 十、特殊情况的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每季度最少分配 1 次，每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额和 D 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 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、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》的有关规定在规定媒介公告。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为对应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## **七、实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，上述收益分配原则仅适用于主袋账户资产和主袋账户份额持有人。

## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
  - 2、基金托管人的托管费；
  - 3、指数许可使用费；
  - 4、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
  - 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
  - 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
  - 7、基金份额持有人大会费用；
  - 8、基金的证券交易费用；
  - 9、基金的银行汇划费用；
  - 10、基金相关账户的开户费用和维护费用；
  - 11、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。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前3个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与银行间市场清算所股份有限公司签署的指数许可使用协议的约定向银行间市场清算所股份有限公司支付指数许可使用费。

指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

若银行间市场清算所股份有限公司对上述指数许可使用费的费用有优惠的，按照优惠后的费用执行。

指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内、按双方协商一致的方式支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、收取下限、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法，此项调整无需召开基金份额持有人大会审议。

### 4、销售服务费

本基金 A 类基金份额和 D 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

上述“一、基金费用的种类”中第 5—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### **三、不列入基金费用的项目**

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；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；《基金合同》生效前的相关费用；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、费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况在履行适当程序后，调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### **五、实施侧袋机制期间的基金费用**

本基金实施侧袋机制期间，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但基金管理人不得就侧袋账户资产收取管理费。

### **六、基金税收**

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

税收征收的规定代扣代缴。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

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



## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》《运作办法》《信息披露办法》《流动性风险管理规定》《基金合同》及其他有关规定。相关法律对信息披露的方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）《基金合同》生效公告

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

公告。

#### （四）基金净值信息

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

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，通过其规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

#### （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，将年度报告登载在规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。如报告期内出现单一投资人持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资人的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情况除外。基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定

报刊和规定网站上。

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

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

- 19、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、调整基金份额类别的设置；
- 23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 24、基金推出新业务或服务；
- 25、本基金连续三十个工作日、四十个工作日、四十五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 5,000 万元人民币的情形；
- 26、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，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注册或者备案，并予以公告。

#### （十）投资资产支持证券信息披露

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。

#### （十一）清算报告

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

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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

## 第十七部分 侧袋机制

为加强对本基金流动性风险的管控，保护投资者的合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及其他有关法律法规，本基金引入侧袋机制作为流动性风险管理工具之一。

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书约定的政策办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。本招募说明书“基金份额的申购、赎回与转换”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

3、基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### **四、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付**

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。

终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### **五、侧袋机制的信息披露**

##### **1、临时公告**

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后，基金管理人应及时发布临时公告。

##### **2、基金净值信息**

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值。

##### **3、定期报告**

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

**六、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。**



## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

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

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

（2）经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

（4）债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险。

（5）购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

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

（7）信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

#### 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

（1）决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

（2）操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

（3）技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

### 3、职业道德风险

公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

### 4、流动性风险

指本基金在开放期内，可能会发生基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的主要流动性风险及其管理方法如下：

#### （1）基金申购、赎回安排

具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“第八部分、基金份额的申购、赎回与转换”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

投资者应当了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险相匹配。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具；本基金投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合等方式，积极防范流动性风险；本基金主动投资流动性受限资产的市值合计占比等，皆严格遵守相关法律法规规定的比例限制。因此，本基金拟投资市场及资产的流动性良好。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

- ①延期办理巨额赎回申请；
- ②延缓支付赎回款项；
- ③摆动定价；
- ④中国证监会认定的其他措施。

#### （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

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

##### ①延期办理巨额赎回申请

具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延期办理巨额赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的

基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### ②暂停接受赎回申请

具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

#### ③延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

#### ④收取短期赎回费

本基金还对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.50%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### ⑤暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四部分、基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

#### ⑥摆动定价

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

#### ⑦侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产

的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

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

⑧中国证监会认定的其他措施。

#### 5、合规性风险

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

#### 6、投资管理风险：

##### （1）指数化投资相关的风险

##### 1) 标的指数的风险

##### ①标的指数下跌的风险

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

##### ②标的指数计算出错的风险

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

##### ③指数编制机构停止服务的风险

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

的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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

#### ④成份券停牌的风险

成份券可能因各种原因临时或长期停牌。发生停牌时，基金可能面临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的风险。

#### ⑤成份券违约的风险

基金在运作过程中可能发生成份券交收违约或发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情形，可能会面临基金资产损失、无法及时调整投资组合、跟踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

### (2) 基金跟踪偏离风险

基金在跟踪标的指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间可能产生差异，主要影响因素可能包括：

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

2) 在标的指数编制中，债券利息计算再投资收益，而基金再投资中未必能获得相同的收益率；

3) 指数调整成份券时，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。

#### 4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内，年化跟踪误差不超过2%，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。

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

本基金法律文件中有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销

售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。

敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

## 8、其他风险

(1) 随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

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

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

## 二、声明

1、投资人投资于本基金，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，本基金还通过基金管理人指定的基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，通过之日起五日内报中国证监会备案，生效之日起两日内在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月，但在基金所持证券流动性受限的客观因素影响情形下，基金财产清算小组可根据清算的具体情况适当延长清算期限，并提前公告。

#### **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。



## 第二十部分 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》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，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》及有关法律的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；

(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、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金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。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基

金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《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定；

(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。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额与 D 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(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，自主判断投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《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定；

(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暂不设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规、基金合同或中国证监会另有规定外，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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经履行适当程序，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内并对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、调低销售服务费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 本基金变更为同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金并相应变更基金类别、修改投资目标、范围和策略；

(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变化；

(6) 《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况；

(7) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务，或调整基金份额类别设置；

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

(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开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；



(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关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 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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 50%（含 50%）；

（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，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第 1 款第（2）项、或者第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

力。

#### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，通过之日起五日内报中国证监会备案，生效之日起两日内在规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案后公告；

(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，基金财产清算小组可根据清算的具体情况适当延长清算期限，并提前公告。

#### (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，应提交上海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，仲裁地点为上海，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、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

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



## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

法定代表人：葛长伟

成立时间：2003 年 8 月 5 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]91 号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务

注册资本：14,097.8 万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售

汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债、可分离交易可转债、可交换债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为债券指数基金，本基金不投资于标的指数成份券发行主体之外的主体发行的信用债券。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如未来法律法规或监管机构对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；

2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5) 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%，回购期限不得超过 1 年，到期后不得展期；

6) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

8) 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；

9) 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)、7)、8) 项规定以外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。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. 向本基金的基金管理人、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. 依照法律法规有关规定，由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。

(4) 法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

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

1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效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。

2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

(6) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

(7) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金投资中期票据进行监督。

1. 基金投资中期票据应遵守有关法律法规的规定，并与基金托管人签订《基金投资中期票据风险控制补充协议》。

2. 基金管理人应将经董事会批准的相关投资决策流程、风险控制制度以及基金投资中期票据相关流动性风险处置预案提供给基金托管人，基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。

基金管理人确定基金投资中期票据的，应根据《托管协议》及相关补充协议的约定向基金托管人提供其托管基金拟购买中期票据的数量和价格、应划付的金额等执行指令所需相关信息，并保证上述信息的真实、准确、完整。

基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资中期票据前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资中期票据出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

(8) 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金投资其

他方面进行监督。

(二)基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、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。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

(三)基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,在规定时间内答复并改正,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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和托管协议规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人有权报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并有权向中国证监会报告。

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

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

### **三、基金管理人对基金托管人的业务核查**

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和托管协议规定,基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户,是否及时、准确复核基金管理人计算

的基金资产净值和各类基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、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》、托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

#### **四、基金财产保管**

##### **（一）基金财产保管的原则**

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户、期货账户、债券托管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和独立。

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

##### **（二）基金募集资产的验证**

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请符合《证券法》规

定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

（5）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》《人民币银行结算账户管理办法》《现金管理暂行条例实施细则》《人民币利率管理规定》《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

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即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

### （五）债券托管账户的开立和管理

（1）基金合同生效后，基金托管人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后在中央国



债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

#### (六) 其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在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，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。

基金管理人、基金托管人根据与期货公司三方签订的《金融期货投资操作备忘录》约定开立相关期货账户。

#### (七) 基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除托管协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### (一) 基金资产净值及各类基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》《关于证券投资基

金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日各类基金份额的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人对外公布。

本基金按以下方法估值：

#### 1、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日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进行估值；

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券和私募债券，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；

(5) 首次公开发行未上市的债券，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。

#### 2、全国银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场交易不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，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；

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

#### 3、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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，若估值日为非证券交易所营业日，以该目标 ETF 最近估值日的基金份额净值估值。

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

定。

6、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。

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

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

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

## （二）净值差错处理

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，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。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）如采用托管协议第八章“基金资产净值及各类基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1—5进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，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，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

（2）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以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

（3）基金管理人、基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于证券交易所及其登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，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降低由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

### （三）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

### （四）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### （五）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方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。

### （六）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （七）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在本基金基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 2 个月内公告；年度报告在会计年度结束后 3 个月内公告。

基金管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，经盖章后，以传真或其他双方约定的方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或以其他双方约定的方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年

度报告、更新招募说明书等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。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。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因托管协议而产生的或与托管协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

托管协议受中华人民共和国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

托管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。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

（4）发生《基金法》《销售办法》《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### （1）基金财产清算小组

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

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

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

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金财产清算小组做出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 基金清算剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的各类基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人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、持有人注册登记服务

基金管理人担任基金注册登记机构，为基金份额持有人提供注册登记服务，配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、基金份额的登记、权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发、基金交易份额的清算过户等服务。

### 二、持有人交易记录查询及对账单服务

#### 1、基金交易确认服务

注册登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金投资记录。基金份额持有人每次交易结束后（T 日），本基金销售网点将于 T+2 日开始为基金份额持有人提供该笔交易成交确认单的查询服务。基金份额持有人也可以在 T+2 日通过本基金管理人客户服务中心查询基金交易情况。基金管理人直销机构网点应根据在直销机构网点进行交易的基金份额持有人的要求打印成交确认单。基金销售机构应根据在销售网点进行交易的基金份额持有人的要求进行成交确认。

#### 2、对账单服务

本公司至少每年度以电子邮件、短信或其他形式向通过广发基金直销系统持有本公司基金份额的持有人提供基金保有情况信息。

基金份额持有人可通过以下方式查阅对账单：

1) 基金份额持有人可登录本基金管理人的网站账户自助查询系统查阅对账单。

2) 基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人订制电子形式的定期对账单。基金交易对账单分为季度对账单和年度对账单，记录该基金份额持有人最近一季度或一年内所有申购、赎回等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。季度对账单在每季结束后的 20 个工作日内向订制季度对账单服务的基金份额持有人以电子邮件形式发送，年度对账单在每年度结束后 20 个工作日内对所有基金份额持有人以电子邮件形式发送。

#### 3、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心（包括电话呼叫中心和网站账户自



助查询系统) 和本基金管理人的销售网点查询历史交易记录。

### 三、信息订制服务

基金份额持有人在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址, 可订制电子邮件服务, 内容包括交易确认及相关基金资讯信息等; 如预留手机号码, 可订制手机短信服务, 内容包括基金净值播报、交易确认等。已开立本公司基金账户未预留相关资料的基金份额持有人可到销售网点或通过基金管理人的客户服务中心(包括电话呼叫中心和网站账户自助查询系统) 办理资料变更。

### 四、信息查询

基金管理人为每个基金账户提供一个基金账户查询密码, 基金份额持有人可以凭基金账号和该密码通过基金管理人的电话呼叫中心(Call Center) 查询客户基金账户信息; 同时可以修改通信地址、电话、电子邮件等信息; 另外还可登录本基金管理人网站查询基金申购与赎回的交易情况、账户余额、基金产品信息。

### 五、投诉受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网站在线客服、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过销售机构的服务电话进行投诉。

### 六、服务联系方式

#### 1、客户服务中心

电话呼叫中心(Call Center): 95105828 或 020-83936999, 该电话可转人工服务。

传真: 020-34281105

#### 2、互联网网站

公司网址: [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

电子信箱: [services@gffunds.com.cn](mailto:services@gffunds.com.cn)

## 第二十三部分 其他应披露事项

公告事项	披露日期
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	2023-04-21
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2023-04-14
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金分红公告	2023-04-12
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金暂停机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2023-04-07
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	2023-03-30
广发基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金分红方式变更规则的公告	2023-02-23
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	2023-01-20
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2023-01-13
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金分红公告	2023-01-11
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金暂停机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2023-01-06
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	2022-10-26
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2022-10-18
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金分红公告	2022-10-15

关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金 暂停机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2022-10-12
广发基金管理有限公司关于调整“特定投资群体(养老金客 户)”的客户适用范围的公告	2022-09-02
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提 示性公告	2022-08-30
广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 2 季度报告 提示性公告	2022-07-20
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金 恢复机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2022-07-13
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金分红 公告	2022-07-12
广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金 经理变更公告	2022-07-11
关于广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金 暂停机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告	2022-07-07

## 第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

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

## 第二十五部分 备查文件

- (一) 中国证监会批准广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书