嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回业务的公告

根据香港交易所2023年7月17日发布的公告，因香港交易所临时停市，为保护基金份额持有人的利益，保障基金平稳运作，经向深圳证券交易所申请，嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称："中概互联网ETF"，代码：159607）于2023年7月17日盘中即时至收市暂停申购、赎回业务。若2023年7月18日香港证券及衍生产品市场恢复正常交易，中概互联网ETF将于同日起恢复办理申购、赎回业务，届时本公司将不再另行公告。若2023年7月18日香港证券及衍生产品市场继续因八号风暴暂停交易，本公司将另行公告中概互联网ETF暂停申购、赎回事宜，敬请投资者留意。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月17日

关于嘉实恒生医疗保健指数发起式（QDII）2023年7月17日暂停申购、赎回及定投业务的公告

公告送出日期：2023年7月17日

1 公告基本信息

基金名称		嘉实恒生医疗保健指数型发起式证券投资基金（QDII）
基金简称		嘉实恒生医疗保健指数发起式（QDII）
基金主代码		018432
基金管理人名称		嘉实基金管理有限公司
公告依据		《嘉实恒生医疗保健指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》、《嘉实恒生医疗保健指数型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》的有关规定，以及香港交易所的休市安排
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2023年7月17日
	暂停赎回起始日	2023年7月17日
	暂停定期定额投资起始日	2023年7月17日
	暂停申购（赎回、定期定额投资）的原因说明	由于极端天气原因，香港证券交易所2023年7月17日全日暂停交易。
下属分级基金的基金简称		嘉实恒生医疗保健指数发起式（QDII）A / 嘉实恒生医疗保健指数发起式（QDII）C
下属分级基金的交易代码		018432 / 018433
该分级基金是否暂停/恢复申购（赎回、定期定额投资）		是 / 是

2 其他需要提示的事项

（1）投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

（2）若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金也将继续暂停申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人将会另行公告。

投资者可登录嘉实基金管理有限公司网站或拨打客户服务电话：400-600-8800咨询相关情况。

关于嘉实恒生消费指数发起（QDII）2023年7月17日暂停申购、赎回及定投业务的公告

公告送出日期：2023年7月17日

1 公告基本信息

基金名称		嘉实恒生消费指数型发起式证券投资基金（QDII）
基金简称		嘉实恒生消费指数发起（QDII）
基金主代码		018200
基金管理人名称		嘉实基金管理有限公司
公告依据		《嘉实恒生消费指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》、《嘉实恒生消费指数型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》的有关规定，以及香港交易所的休市安排
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2023年7月17日
	暂停赎回起始日	2023年7月17日
	暂停定期定额投资起始日	2023年7月17日
	暂停申购（赎回、定期定额投资）的原因说明	由于极端天气原因，香港证券交易所2023年7月17日全日暂停交易。
下属分级基金的基金简称		嘉实恒生消费指数发起（QDII）A / 嘉实恒生消费指数发起（QDII）C
下属分级基金的交易代码		018200 / 018201
该分级基金是否暂停/恢复申购（赎回、定期定额投资）		是 / 是

2 其他需要提示的事项

（1）投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

（2）若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金也将继续暂停申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人将会另行公告。

投资者可登录嘉实基金管理有限公司网站或拨打客户服务电话：400-600-8800咨询相关情况。

关于嘉实全球创新龙头股票（QDII）2023年7月17日暂停申购、赎回及定投业务的公告

公告送出日期：2023年7月17日

1 公告基本信息

基金名称		嘉实全球创新龙头股票型证券投资基金（QDII）		
基金简称		嘉实全球创新龙头股票（QDII）		
基金主代码		017429		
基金管理人名称		嘉实基金管理有限公司		
公告依据		《嘉实全球创新龙头股票型证券投资基金（QDII）基金合同》、《嘉实全球创新龙头股票型证券投资基金（QDII）招募说明书》的有关规定，以及纽约证券交易所、纳斯达克证券交易所、香港交易所的休市安排		
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2023年7月17日		
	暂停赎回起始日	2023年7月17日		
	暂停定期定额投资起始日	2023年7月17日		
	暂停申购（赎回、定期定额投资）的原因说明	由于极端天气原因，香港证券交易所2023年7月17日全日暂停交易。		
下属分级基金的基金简称		嘉实全球创新龙头股票（QDII）人民币A	嘉实全球创新龙头股票（QDII）美元	嘉实全球创新龙头股票（QDII）人民币C
下属分级基金的交易代码		017429	017430	017431
该分级基金是否暂停/恢复申购（赎回、定期定额投资）		是	是	是

2 其他需要提示的事项

（1）投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

（2）若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金也将继续暂停申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人将会另行公告。

投资者可登录嘉实基金管理有限公司网站或拨打客户服务电话：400-600-8800咨询相关情况。

关于嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）2023年7月17日申购、赎回及定投业务的申请不予确认的公告

根据香港交易所公告，受台风影响，香港交易所宣布2023年7月17日全日暂停交易，根据嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"；A类基金简称：嘉实港股通新经济指数（LOF）A（场内简称：新经济HK；扩位场内简称：新经济港股通LOF），A类基金代码：501311；C类基金简称：嘉实港股通新经济指数（LOF）C，C类基金代码：006614）基金合同的规定，投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金的申购（含定投）、赎回业务申请不予确认也将顺延，详见届时公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月17日

关于嘉实H股指数(QDII-LOF)2023年7月17日暂停申购、赎回及定投业务的公告

公告送出日期：2023年7月17日

1 公告基本信息

基金名称		嘉实恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)
基金简称		嘉实H股指数(QDII-LOF)
场内简称		H股LOF
基金主代码		160717
基金管理人名称		嘉实基金管理有限公司
公告依据		《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》、《嘉实恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF)招募说明书》的有关规定，以及香港交易所的休市安排。
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2023年7月17日
	暂停赎回起始日	2023年7月17日
	暂停定期定额投资起始日	2023年7月17日
	暂停申购（赎回、定期定额投资）的原因说明	由于极端天气原因，香港证券交易所2023年7月17日全日暂停交易。

2 其他需要提示的事项

（1）投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

（2）若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金也将继续暂停申购（含定投）、赎回业务，本基金管理人将会另行公告。

投资者可登录嘉实基金管理有限公司网站或拨打客户服务电话：400-600-8800咨询相关情况。

关于增加湘财证券为嘉实中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金网下认购销售机构的公告

根据嘉实基金管理有限公司与湘财证券股份有限公司签署的开放式基金销售协议，上述销售机构自2023年7月18日起对所有投资者办理嘉实中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"）的开户、网下现金认购、网下股票认购等业务。

投资者可以通过以下途径咨询，了解有关详情：

一、参与网下现金、网下股票认购销售机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1.	湘财证券股份有限公司	注册地址、住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼 法人代表：高振营 电话：(021)38784580 联系人：江恩前 客服电话：95351 网址：http://www.xcsc.com

二、嘉实基金管理有限公司

客户服务电话：400-600-8800

网址：www.jsfund.cn

欢迎广大投资者垂询、惠顾办理本基金的开户、网下现金认购、网下股票认购等相关业务。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月18日

关于嘉实欣荣混合（LOF）2023年7月17日申购、赎回、转换及定投业务的申请不予确认的公告

根据香港交易所公告，受台风影响，香港交易所宣布2023年7月17日全日暂停交易，根据嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"；A类基金简称：嘉实欣荣混合（LOF）A（场内简称：嘉实欣荣；扩位场内简称：嘉实欣荣LOF），A类基金代码：501091；C类基金简称：嘉实欣荣混合（LOF）C，C类基金代码：017767）基金合同的规定，投资者于2023年7月17日提交的本基金申购、赎回、转换、定期定额投资业务申请，本基金管理人将不予确认，由此给投资者带来的不便，敬请谅解。

若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本基金将于同日恢复申购（含定投）、赎回、转换业务，本基金管理人不再另行公告；若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本基金的申购（含定投）、赎回、转换业务申请不予确认也将顺延，详见届时公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月17日

关于嘉实500交易型开放式指数证券投资基金联接基金修订托管协议的公告

为应对复杂多变的证券市场环境，更好地维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》等法律法规、以及基金基金合同、托管协议等有关规定，嘉实基金管理有限公司（以下简称"基金管理人"或"本公司"）与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案后，决定调整嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的交收效率，并相应修订托管协议。

一、托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
七、交易及清算交收安排	（四）申赎净额结算 基金托管账户与"基金清算账户"间的资金结算遵循"净额清算、轧差交收"的原则，每日(T日：资金交收日，下同)按照托管账户应收资金（T-1日直销申购申请对应申购金额、T-2日代销申购申请对应申购金额与T-2日基金转换入申请对应金额之和）与应付资金（T-3日赎回申请对应赎回金额与T-2日基金转换出申请对应金额之和）的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时，基金管理人应在T日15:00之前从基金清算账户划到基金托管账户，基金托管人在资金到账后应立即通知基金管理人，并将有关书面凭证传真给基金管理人进行账务管理；当存在托管账户净应付额时，基金管理人应在T-1日将划款指令发送给基金托管人，基金托管人按基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在T日12:00之前划往基金清算账户，基金托管人在资金划出后立即通知基金管理人，并将有关书面凭证交给基金管理人进行账务管理。 当存在托管账户净应付额时，如基金银行账户有足够的资金，基金托管人应按时拨付；因基金银行账户没有足够的资金，导致基金托管人不能按时拨付，基金托管人应及时通知基金管理人，如系基金管理人的原因造成，责任由基金管理人承担，基金托管人不承担垫款义务。	（四）申赎净额结算 基金清算账户由基金管理人开设并管理。基金托管账户与"基金清算账户"间的资金清算遵循"净额清算、净额交收"的原则，因按照托管账户当日应收资金（包括申购资金及基金转换转入款）与托管账户应付额（含赎回资金、扣除归入基金财产的赎回费、基金转换转出款及扣除归入基金财产的转换费）的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。 当存在托管账户净应收额时，基金管理人将托管账户净应收额在交收日15:00前从"基金清算账户"划到基金的托管账户；当存在托管账户净应付额时，基金管理人应在交收日10:00前将划款指令发送给基金托管人，基金托管人按基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日15:00前划往"基金清算账户"。

二、重要提示

本次修订已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，根据法律法规及基金合同的约定，无需召开基金份额持有人大会进行表决。修订内容自2023年7月18日起生效。

投资者可登录本公司网站（www.jsfund.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）查阅修订后的托管协议全文或拨打本公司客服电话（400-600-8800）咨询。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。投资者在投资基金之前，请仔细阅读基金的产品资料概要（更新）、招募说明书（更新）和基金合同，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月18日

嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金2023年7月17日因港股通恶劣天气暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告

根据嘉实基金管理有限公司（以下简称"本公司"）旗下部分基金的《基金合同》及《招募说明书》相关约定：基金申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，若该工作日为非港股通交易日，则基金不开放或基金管理人有权决定基金是否开放申购、赎回等业务。

根据香港交易所通知，受台风影响，香港交易所宣布2023年7月17日全日暂停交易。为保障基金平稳运作，维护基金份额持有人利益，本公司决定对部分基金在2023年7月17日全天暂停申购、赎回、转换及定投等业务（具体业务类型以各基金实际情况为准）。若2023年7月18日香港交易所恢复正常交易，本公司将于同日起恢复办理部分基金申购、赎回、转换及定投等业务，届时本公司将不再另行公告。若2023年7月18日香港交易所继续暂停交易，本公司将继续暂停申购、赎回、转换及定投等业务，届时本公司将会另行公告。

适用基金如下：

序号	基金代码	基金名称
1	001878	嘉实沪港深精选股票
2	004477	嘉实沪港深回报混合
3	004450	嘉实前沿科技沪港深股票
4	005267	嘉实价值精选股票
5	005303	嘉实医药健康股票A
	005304	嘉实医药健康股票C
6	005612	嘉实核心优势股票
7	005662	嘉实金融精选股票A
	005663	嘉实金融精选股票C
8	005660	嘉实资源精选股票A
	005661	嘉实资源精选股票C
9	006803	嘉实互通精选股票
10	006603	嘉实互融精选股票
11	006604	嘉实消费精选股票A
	006605	嘉实消费精选股票C
12	007343	嘉实科技创新混合
13	007895	嘉实价值成长混合
14	008958	嘉实回报精选股票
15	009126	嘉实基础产业优选股票A
	009127	嘉实基础产业优选股票C
16	009138	嘉实瑞成两年持有期混合A
	009139	嘉实瑞成两年持有期混合C
17	009869	嘉实产业先锋混合A
	009870	嘉实产业先锋混合C
18	008150	嘉实远见企业精选两年持有期混合
19	009993	嘉实前沿创新混合
20	009994	嘉实创新先锋混合A
	009995	嘉实创新先锋混合C
21	010186	嘉实核心成长混合A
	010187	嘉实核心成长混合C
22	009909	嘉实动力先锋混合A
	009910	嘉实动力先锋混合C
23	009558	嘉实稳惠6个月持有期混合A
	009559	嘉实稳惠6个月持有期混合C
24	010275	嘉实优质精选混合A
	010276	嘉实优质精选混合C
25	010273	嘉实价值长青混合A
	010274	嘉实价值长青混合C
26	010041	嘉实港股优势混合A
	010042	嘉实港股优势混合C
27	011248	嘉实品质回报混合
28	010437	嘉实竞争力优选混合A
	010438	嘉实竞争力优选混合C
29	011246	嘉实阿尔法优选混合A
	011247	嘉实阿尔法优选混合C
30	011626	嘉实匠心回报混合A
	011627	嘉实匠心回报混合C
31	011518	嘉实价值臻选混合
32	010361	嘉实品质优选股票A
	010362	嘉实品质优选股票C
33	012344	嘉实领先优势混合A
	012345	嘉实领先优势混合C
34	012225	嘉实优势精选混合A
	012226	嘉实优势精选混合C
35	012671	嘉实核心蓝筹混合A
	012672	嘉实核心蓝筹混合C
36	011643	嘉实时代先锋三年持有期混合A
	011644	嘉实时代先锋三年持有期混合C
37	011924	嘉实港股互联网产业核心资产混合A
	011925	嘉实港股互联网产业核心资产混合C
38	012067	嘉实蓝筹优势混合A
	012068	嘉实蓝筹优势混合C
39	012852	嘉实远见先锋一年持有期混合A
	012853	嘉实远见先锋一年持有期混合C
40	013055	嘉实策略机遇混合发起式A
	013056	嘉实策略机遇混合发起式C
41	013189	嘉实稳健添利一年持有混合
42	011249	嘉实稳裕混合A
	011250	嘉实稳裕混合C
43	011805	嘉实优质核心两年持有期混合A
	011806	嘉实优质核心两年持有期混合C
44	012466	嘉实策略精选混合A
	012467	嘉实策略精选混合C
45	014292	嘉实产业领先混合A
	014293	嘉实产业领先混合C
46	012065	嘉实民安添复一年持有期混合A
	012066	嘉实民安添复一年持有期混合C
47	014307	嘉实多元动力混合A
	014308	嘉实多元动力混合C
48	014852	嘉实添惠一年持有混合A
	014853	嘉实添惠一年持有混合C
49	011516	嘉实浦盈一年持有期混合A
	011517	嘉实浦盈一年持有期混合C
50	012995	嘉实策略视野三年持有期混合
51	013630	嘉实均衡臻选一年持有期混合A
	013631	嘉实均衡臻选一年持有期混合C
52	014074	嘉实内需精选混合A
	014075	嘉实内需精选混合C
53	011841	嘉实兴锐优选一年持有期混合A
	011842	嘉实兴锐优选一年持有期混合C
54	014872	嘉实品质蓝筹一年持有期混合A
	014873	嘉实品质蓝筹一年持有期混合C
55	013995	嘉实融惠混合A
	013996	嘉实融惠混合C
56	013439	嘉实产业优势混合A
	013440	嘉实产业优势混合C
57	013624	嘉实价值创造三年持有期混合A
	013625	嘉实价值创造三年持有期混合C
58	009137	嘉实瑞和两年持有期混合
59	009795	嘉实远见精选两年持有期混合
60	012533	嘉实价值驱动一年持有期混合A
	012534	嘉实价值驱动一年持有期混合C
61	011168	嘉实睿享安久双利18个月持有期债券
62	013855	嘉实品质发现混合A
	013856	嘉实品质发现混合C
63	016570	嘉实价值丰润混合A
	016571	嘉实价值丰润混合C
64	016797	嘉实双利债券A
	016798	嘉实双利债券C
65	017112	嘉实优享生活混合A
	017113	嘉实优享生活混合C
66	017086	嘉实ESG可持续投资混合A
	017087	嘉实ESG可持续投资混合C
67	016568	嘉实碳中和主题混合A
	016569	嘉实碳中和主题混合C

特别提示：

1、各基金是否已开放申购、赎回、转换及定投等业务，详见本公司发布的相关公告。

2、本公告主要为基金因港股通恶劣天气暂停及后续恢复相关业务的说明，各基金如因其他原因已暂停申购、赎回、转换、定投、大额申购、大额转换转入业务或有其他交易状态限制的，本次恢复后仍受相关交易状态限制，具体业务办理以相关公告为准。

嘉实基金管理有限公司
2023年7月17日

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二零二三年七月

鉴于嘉实基金管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力，拟募集发行嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金；

鉴于中国建设银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；

鉴于嘉实基金管理有限公司拟担任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人，中国建设银行股份有限公司拟担任嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金托管人；

为明确嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本托管协议；

除非另有约定，《嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称"基金合同")中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以基金合同为准，并依其条款解释。

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A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12A层

邮政编码：100005

法定代表人：经雷

成立日期：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]5号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及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：田国立

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：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元

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、基金托管协议的依据、目的和原则

（一）订立托管协议的依据

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集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》")等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。

（二）订立托管协议的目的

订立本协议的目的是明确基金管理人与基金托管人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（三）订立托管协议的原则

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人合法权益的原则，经协商一致，签订本协议。

三、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。

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。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。届时本基金参与融资融券、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决定。

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

(1)本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；

(2)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

(3)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%，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%；

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

(6)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

(8)本基金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；

(9)基金资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；

(10)本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的5%，经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；因流通受限证券价格波动、基金规模变动、上市公司合并等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券并在流通受限期结束后卖出流通受限证券；

(11)本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；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95%。其中，有价证券指股票、目标ETF、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。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及目标ETF的20%。本基金所持有的股票市值、目标ETF和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不得超过基金资产净值的95%。本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。本基金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，应当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。

(12)本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%。

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

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

（15）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规或中国证监会的相关规定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。

除第（8）、（13）、（14）项以外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（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，基金管理人及时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，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

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

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

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

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