交银施罗德基金管理有限公司
BANK OF COMMUNICATIONS Schroders

交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（更新）招募说明书

（2012年第2号）

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一二年九月

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经 2009 年 8 月 17 日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】795 号文核准募集。本基金基金合同于 2009 年 9 月 29 日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场，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，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为 ETF 联接基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 9 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

目 录

一、绪言 3
二、释义 4
三、基金管理人 9
四、基金托管人 18
五、相关服务机构 23
六、基金的募集 31
七、基金合同的生效 33
八、基金份额的申购与赎回 34
九、基金的转换 49
十、基金的投资 65
十一、基金的业绩 76
十二、基金的财产 78
十三、基金资产的估值 79
十四、基金的收益与分配 86
十五、基金的费用与税收 88
十六、基金的会计与审计 90
十七、基金的信息披露 91
十八、风险揭示 96
十九、基金合同的终止与基金财产的清算 100
二十、基金合同内容摘要 102
二十一、托管协议的内容摘要 118
二十二、对基金份额持有人的服务 134
二十三、其他应披露事项 136
二十四、招募说明书的存放及查阅方式 138
二十五、备查文件 139

一、绪言

《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他相关法律法规的规定以及《交银施罗德上证 180 公司治理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”）编写。

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

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

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2、基金管理人或本基金管理人：指交银施罗德基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）

4、基金合同：指《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

9、《证券法》： 指 2005 年 10 月 27 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议通过，自 2006 年 1 月 1 日实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

14、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

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：指中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者

21、基金投资者或投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

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基金投资者

23、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，办理基金份额的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指直销机构和代销机构

25、直销机构：指交银施罗德基金管理有限公司

26、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为交银施罗德基金管理有限公司或接受交银施罗德基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

30、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、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

31、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户

32、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

33、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

34、目标 ETF：指另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（简称 ETF），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且，该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。发售时，本基金选择上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF

35、ETF 联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标 ETF 的 ETF 联接基金

36、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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、日：指公历日

40、月：指公历月

41、T 日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效业务申请的工作日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

43、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

45、《业务规则》：指《交银施罗德基金管理有限公司开放式基金业务规则》

46、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买本基金基金份额的行为

47、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买本基金基金份额的行为

48、赎回：指在基金存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求卖回本基金基金份额的行为

49、标的指数：指上海证券交易所编制并发布的上证 180 公司治理指数及其未来可能发生的变更

50、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的公告，在本基金基金份额与基金管理人管理的，且由同一注册登记机构办理登记结算的其他基金基金份额间进行的转换行为

51、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变更所持基金份额销售机构的操作

52、定期定额投资计划：指投资者通过向有关销售机构提交申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构在投资者指定资金账户内自动扣款并于每期约定申购日提交基金申购申请的一种投资方式

53、巨额赎回：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)超过上一日基金总份额的 10%

54、元：指人民币元

55、基金利润：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、投资目标 ETF 份额所得收益、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

56、基金资产总值：指基金拥有的包括目标 ETF 份额在内的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

57、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

58、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

59、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

60、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站

及其他媒体

61、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，且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼

邮政编码：200120

法定代表人：钱文挥

成立时间：2005年8月4日

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：陈超

电话：(021)61055050

传真：(021)61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司（以下使用全称或其简称“交通银行”）	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	5%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责，下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会，其中投资决策委员会包括公募基金（除QDII）投资决策委员会、QDII投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作

的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究条线下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部、量化投资部及跨境投资部。中央交易室隶属总经理直接管理。市场条线下设产品开发部、营销策划部、零售理财部、营销管理部、机构理财部、上海营销中心、北京分公司、广州分公司、西部营销中心。营运条线下设财务部、基金运营部与信息技术部。综合管理条线下设人力资源部和行政部。监察稽核条线下设监察稽核部、风险管理部、法务部，由督察长协同总经理直接管理。此外，根据业务需要，增设了战略发展部。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

截止到2012年三季度末，公司已经发行并管理了21只基金，包括1只货币市场基金、3只债券型基金、1只保本混合型基金、3只混合型基金、13只股票型基金，其中2只为QDII基金，2只为交易型开放式基金（ETF），2只为ETF联接基金。

截止到2012年9月30日，公司有员工206人，其中53%的员工具有硕士以上学历。

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

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。现任交通银行股份有限公司执行董事，副行长。历任中国建设银行资产负债管理委员会办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理委员会办公室主任兼体制改革办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理部总经理、资产负债管理部总经理兼重组改制办公室主任、交通银行股份有限公司副行长兼上海分行行长。

雷贤达先生，副董事长，学士学历，加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理（香港）有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

战龙先生，董事，总经理，CFA、CPA，硕士学历。历任安达信（新加坡）有限公司审计师，澳洲信孚基金管理有限公司投资风险管理副总监，信安资产管理亚洲有限公司投资风险管理总监，荷兰国际投资管理亚太有限公司中国区总经理，招商基金管理有限公司常务副总经理，富达国际中国董事总经理。

阮红女士，董事，博士学历。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理，现任交通银行投资管理部总经理。

吴伟先生，董事，博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长、预算财务部副总经理、总经理，现任交通银行沈阳分行行长。

葛礼达先生，董事，大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官、施罗德集团亚太地区总裁,现任施罗德集团亚太区董事长。

谢丹阳先生，独立董事，博士学历。历任蒙特利尔大学经济系助理教授，国际货币基金经济学家和高级经济学家，香港科技大学助理教授、副教授、教授、系主任，现任香港科技大学教授、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生，独立董事，博士学历。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任，现任复旦大学经济学院院长。

周林先生，独立董事，博士学历。历任复旦大学管理科学系助教，美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授，美国杜克大学经济系副教授，香港城市大学经济与金融系教授，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院经济系冠名教授，上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授，现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

康定选先生，监事长，EMBA，高级经济师。历任河南巩县农业银行信贷股信贷员、副股长，巩县支行副行长；郑州市农业银行行政区办事处副主任；交通银行郑州分行信贷部副主任、计划信贷处处长、副行长；交通银行南京分行副行长、行长；交通银行上海分行行长。

裴关淑仪女士，监事，CFA、CIPM、FRM，工商管理、资讯管理双硕士。曾任职荷兰银行、渣打银行（香港）有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED，

施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事、交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

陈超女士，监事，硕士学历。历任交通银行股份有限公司资产托管部内控综合员，交银施罗德基金管理有限公司董事会秘书、合规审计部总经理，现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理兼董事会秘书。

3、公司高管人员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。简历同上。

战龙先生，董事，总经理，硕士学历。简历同上。

苏奋先生，督察长，纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理，交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人，交通银行投资管理部投资并购高级经理，交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师，湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理，湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

谢卫先生，副总经理，经济学博士，高级经济师。历任中央财经大学金融系教员；中国社会科学院财经所助理研究员；中国电力信托投资公司基金部副经理；中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理；富国基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

屈乐伟先生，基金经理。数理系硕士。16 年证券投资从业经验。历任广发证券北京业务总部研发部经理、投资部经理；华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证 50ETF 基金经理助理。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2009 年 9 月 25 日起担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金经理至今，2009 年 9 月 29 日起兼任本基金基金经理至今，2011 年 9 月 22 日起兼任深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理至今，并于 2011 年 9 月 28 日起兼任交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理至今。

蔡铮先生，基金经理助理。复旦大学电子工程硕士。4 年证券从业经验。历任瑞士银行香港分行分析员。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师。2011 年 3 月 7 日起担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金及本基金基金经理助理至今，2011 年 9 月 22 日起兼任深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理至今，并于 2011 年 9 月 28 日起兼任交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：项廷锋（投资总监、基金经理）

战龙（总经理）

管华雨（权益部总经理、基金经理）

胡军华（固定收益部总经理）

张科兵（研究部总经理、基金经理）

上述人员之间无近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、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、半年度和年度基金报告；

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、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

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

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

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产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）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

（五）基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（六）基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的风险管理部，风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

（3）相互制约原则

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

（4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

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

（1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

（2）监事会

是公司常设的监事机构，对股东会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人员进行监督。

（3）合规审核及风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，对公司内部控制制度、监察稽核制度进行检查评估；审查公司财务，对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议；对公司资产与基金资产的经营进行评估。

（4）风险控制委员会

作为总经理下设的专业委员会之一，风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策，制定灾难复原计划及紧急情况处理制度，确保公司风险控制符合标准，就潜在风险与相关部门协调，审阅公司审计报告及监察情况。

（5）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

（6）风险管理部

风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及控制措施，组织执行，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，汇总公司业务所有的风险信息，独立识别、评估各类风险，提出风险控制建议，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

（7）监察稽核部

监察稽核部负责设计及实施公司合规审计计划，检查公司各项业务的合规情况及监督公司内部规章制度的执行情况，定期向监管机构及公司管理层进行汇报。

（8）法务部

法务部负责公司的法律事务及协调实施信息披露事务，依法维护公司合法权益，评判并处理公司运营中发生的法律及信息披露相关问题，及时向公司管理层及全体员工传达法规及监管要求。

（9）业务部门

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

3、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控体系，完善内控制度

公司建立、健全了内控体系，通过高管人员关于内控的明确分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动独立，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

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

（3）建立、健全岗位责任制

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

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

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

（5）建立有效的内部监控系统

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

（6）使用数量化的风险管理手段

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

（7）提供足够的培训

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

四、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（以下使用其全称或简称“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

电话：（010）63201510

传真：（010）63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、

内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 146 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年9月29日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共132只，包括交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、

大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证

券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了

专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效；业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密；业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户，基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

机构名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 10 楼

法定代表人：钱文挥

成立时间：2005 年 8 月 4 日

电话：（021）61055027

传真：（021）61055054

联系人：许野

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理开户、本基金的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：www.jyfund.com，www.jysld.com, www.bocomschroder.com。

2、代销机构

（1） 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

电话：（010）85108227

传真：（010）85109219

联系人：刘一宁

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（2） 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3） 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

电话：（010）66275654

传真：（010）66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（4） 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

传真：（010）66594853

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

（5） 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（6） 招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（7） 上海银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

电话：（021）68475888

传真：（021）68476111

联系人：张萍

客户服务电话：（021）962888

网址：www.bankofshanghai.com"\

（8） 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：李晓鹏

客户服务电话：800-830-8003，400-830-8003

网址：www.gdb.com.cn

（9） 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

电话：（010）65557083

传真：（010）65550827

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（10） 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

电话：（010）57092615

传真：（010）57092611

联系人：董云巍

客户服务电话： 95568

网址：www.cmbc.com.cn

（11） 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：（010）68098778

传真：（010）68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

（12） 宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话：（021）63586210

传真：（021）63586215

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海地区 962528）

网址：www.nbcb.com.cn

（13） 北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

电话：（010）66223584

传真：（010）66226045

联系人：谢小华

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（14） 平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：（0755）82088888

联系人：张青

客户服务电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

（15） 江苏银行股份有限公司

住所：南京市洪武北路 55 号

办公地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

电话：（025）58587018

传真：（025）58587038

联系人：田春慧

客户服务电话：96098，40086-96098

网址：www.jsbchina.cn

（16） 华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴健

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（17） 杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：（0571）85108309

传真：（0571）85151339

联系人：严峻

客户服务电话:（0571）96523，400-8888-508

网址：www.hzbank.com.cn

（18） 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）23219100

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

（19） 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

电话：（0571）28829790，（021）60897869

传真：（0571）26698533

联系人：周嫣旻

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（20） 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

电话：（0755）33227953

传真：（0755）82080798

联系人：汤素娅

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（21） 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：（021）58788678

传真：（021）58787698

联系人：沈雯斌

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

联系人：金毅

经办注册会计师：汪棣、金毅

六、基金的募集

（一）本基金的募集情况

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可[2009]795号文核准募集发售。

本基金为契约型开放式ETF联接基金。基金存续期间为不定期。

本基金募集期间基金份额净值为人民币1.00元，按初始面值发售。

本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自2009年8月31日至2009年9月23日止进行发售。

本基金设立募集期共募集 7,090,257,767.14 份基金份额，有效认购户数为78,610户。

（二）本基金与目标ETF的差异

1、交易方式的差异

本基金为目标 ETF 的联接基金，投资者可以通过本基金的销售机构申购赎回本基金的基金份额。

本基金的目标 ETF 属于交易型开放式指数证券投资基金，投资者可以通过目标ETF的申购赎回代理券商申购赎回目标ETF的基金份额。此外，目标ETF符合上市条件申请上市成功后，投资者还可通过上海证券交易所的交易系统在二级市场买卖目标ETF的基金份额。

2、申购赎回方式的差异

本基金为目标 ETF 的联接基金，属于开放式证券投资基金。投资者申购赎回本基金基金份额均采用现金方式，申购以金额申请，赎回以份额申请。投资者申购本基金时应支付现金申购款，赎回本基金时基金管理人应向投资者支付现金赎回款，申购与赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基础；

本基金的目标ETF属于交易型开放式证券投资基金。投资者申购赎回目标ETF基金份额均采用实物申购赎回方式，申购和赎回均以份额申请。投资者申购 ETF 基金份额时应根据基金管理人公告的申购赎回清单交付申购对价，包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。投资者赎回基金份额时，基金管理人应根据申购赎回清单交付给投资者赎回对价，包括组合证券、现金替代、现金差额及其他

对价。申购、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

3、投资方法的差异

本基金为目标 ETF 的联接基金，属于开放式证券投资基金，以被动式的指数化投资管理方式，将 90%以上的基金净资产投资于目标 ETF，实现紧密跟踪标的指数的投资目标；

本基金的目标 ETF 属于交易型开放式指数证券投资基金，采用完全复制法紧密跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。

4、业绩表现的差异

本基金为目标 ETF 的联接基金，将 90%以上的基金净资产投资于目标 ETF，以紧密跟踪标的指数，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生业绩表现差异的原因包括以下几个方面：

（1)本基金基金份额的赎回采用现金方式,为支付现金赎回款,相比目标 ETF，本基金需要保留更多的现金资产；

（2）本基金基金份额的申购采用现金方式，在利用到账的申购资金投资目标 ETF 过程中，市场波动等原因会造成本基金与目标 ETF 表现的差异；

（3）本基金为应对投资者以现金方式申购赎回本基金基金份额而进行的证券交易需支付一定的手续费，此等费用将影响本基金相对于目标 ETF 的表现。

七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同已于 2009 年 9 月 29 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的场所

投资者可通过下述场所按照规定的方式进行申购或赎回：

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 10 楼

电话：（021）61055027

传真：（021）61055054

联系人：许野

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.jyfund.com,www.jysld.com,www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理开户、本基金的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址：www.jyfund.com,www.jysld.com,www.bocomschroder.com

2、代销机构的代销网点

本基金的代销机构的代销网点请见本招募说明书“五、相关服务机构”章节或拨打本公司客户服务电话进行咨询。

上述代销机构中，中国农业银行和中国光大银行股份有限公司只代销本基金的前端收费基金份额，其他代销机构代销本基金的前、后端收费基金份额。

投资者可通过上述场所按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日是指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（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）。基金投资者在开放日申请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。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，若该申请被成功确认，则其基金份额申购、赎回及转换价格为下次办理基金份额申购、赎回及转换时间所在开放日的价格。

2、申购的开始日及业务办理时间

本基金已于 2009 年 12 月 29 日起开放申购业务。

3、赎回的开始日及业务办理时间

本基金已于 2009 年 12 月 29 日起开放赎回业务。

（三）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额的申购与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、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金投资者认购、申购和红利再投的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

（四）申购和赎回的数额限定

1、申购金额的限制

代销网点每个账户单笔申购的最低金额为单笔 1,000 元。

直销中心每个账户首次申购的最低金额为单笔 100,000 元，追加申购的最低金额为单笔 10,000 元；已在直销中心有认购或申购过本基金管理人管理的任一基金（包括本基金）记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。通过本公司网上交易系统办理基金申购业务的不受直销中心单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔 1,000 元。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

2、赎回份额的限制

赎回的最低份额为单笔 50 份基金份额。

3、最低保留余额的限制

每个工作日投资者在单个交易账户保留的本基金份额余额少于 50 份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，则基金管理人有权将投资者在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定的媒体上公告。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效而不予成交。

投资者在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日(T日)，正常情况下，本基金注册登记机构在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，投资者可在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。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人在 T＋7 日（包括该日）内从托管账户将赎回款项划出，经销售机构划往基金份额持有人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

4、申购和赎回基金份额的份额注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理份额注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的份额注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述份额注册登记办理时间进行调整，但不得影响投资者实质的合法权益，并依照《信息披露办法》的有关规定于开始实施前在指定媒体上公告。

（六）基金的申购费和赎回费

1、申购费用

本基金提供两种申购费用的支付模式。投资者可以选择前端收费模式，即在申购时支付申购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间递减。

本基金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。

投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下：

	申购金额（含申购费）	前端申购费率
申购费率（前端）	50 万元以下	1.5%
	50 万元（含）至 100 万元	1.2%
	100 万元（含）至 200 万元	0.8%
	200 万元（含）至 500 万元	0.5%
	500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元

	持有时间	后端申购费率
申购费率（后端）	1 年以内（含）	1.8%
	1 年—3 年（含）	1.2%
	3 年—5 年（含）	0.6%
	5 年以上	0

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

2、赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的 25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率如下：

	持有期限	赎回费率
赎回费率	1 年以内（含）	0.5%
	1 年—2 年（含）	0.2%
	2 年以上	0.0%

3、网上交易的有关费率

本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以直接通过本公司网站的“交银施罗德基金管理有限公司 e 网行基金网上直销系统”（以下简称“e 网行”）办理开户和本基金前端基金份额的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上交易后端基金份额的认/申购业务，通过转托管转入网上直销账户的后端收费模式的基金份额只能办理赎回业务。通过 e 网行办理本基金前端基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率优惠，通过 e 网行办理本基金前端收费模式下转换入业务的个人投资者将享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的 e 网行直销申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

个人投资者通过本基金管理人 e 网行申购本基金前端基金份额的单笔最低金额为 1000 元（含），单笔定期定额投资最低金额为 200 元（含），不受网上直销日

常申购的最低金额限制；单笔转换份额不得低于 200 份，投资者可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求，并依据相关法规的要求提前进行公告。

4、基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定调整申购费率、降低赎回费率或调整收费方式，最新的申购费率和赎回费率以及收费方式在更新的招募说明书中列示。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），在不违背法律法规规定的情况下，基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

6、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，可适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

（七）申购和赎回的数额和价格

1、申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）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申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、申购份额的计算

（1）前端收费模式：

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/（1+申购费率）

申购费用=申购总金额-净申购金额

申购份额=（申购总金额-申购费用）/ T 日基金份额净值

例一：某投资者投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如果其选择前端收费方式，申购费率为 1.5%，则其可得到的申购份额为：

申购总金额＝40,000 元

净申购金额=40,000/（1+1.5%）=39,408.87 元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13 元

申购份额=（40,000-591.13）/1.040=37,893.14 份

（2）后端收费模式：

申购总金额=申请总金额

申购份额＝申购总金额/T 日基金份额净值

当投资者提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

后端申购费用＝赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

例二：某投资者投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝40,000/1.040＝38,461.54 份

即：投资者投资 40,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则可得到 38,461.54 份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

3、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

（1）如果投资者在认（申）购时选择交纳前端认（申）购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-赎回费用

例三：某投资者赎回通过前端认购（申购）持有的 10,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = 10,000×1.016×0.5% ＝ 50.80 元

赎回金额 = 10,000×1.016-50.80 ＝ 10,109.20 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

（2）如果投资者在认（申）购时选择交纳后端认（申）购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×T 日基金份额净值

后端认（申）购费用＝赎回份额×认（申）购日基金份额净值×后端认（申）购费率

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－后端认（申）购费用－赎回费用

例四：某投资者赎回通过后端认购持有的 10,000 份基金份额，对应的后端认购费率为 1.6%，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

后端认购费用 = 10,000×1.00×1.6% = 160.00 元

赎回费用 = 10,000×1.016×0.5% ＝ 50.80 元

赎回金额 = 10,000×1.016-160.00-50.80 ＝ 9,949.20 元

即：投资者赎回通过后端认购所得本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 9,949.20 元。

例五：某投资者赎回通过后端申购持有的 10,000 份基金份额，对应的后端申购费率为 1.8%，赎回费率为 0.5%，假设申购当日基金份额净值是 1.010 元，赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

后端申购费用 = 10,000×1.010×1.8% = 181.80 元

赎回费用 = 10,000×1.016×0.5% ＝ 50.80 元

赎回金额 = 10,000×1.016-181.80-50.80 ＝ 9,927.40 元

即：投资者赎回通过后端申购所得本基金 10,000 份基金份额，假设申购当日基金份额净值是 1.010 元，赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 9,927.40 元。

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值＝基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T＋1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作；

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日的基金资产净值；

（3）所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（4）所投资的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌；

（5）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（6）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为继续接受申购会损害已有基金份额持有人利益；

（7）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的，或违反有关法律法规的某笔申购或某些申购；

（8）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1－6、8 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将全额退还投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者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）证券交易场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；

（3）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

（4）所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（5）所投资的目标ETF暂停赎回；

（6）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（7）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会报告，已接受的赎回申请，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，若发生上述第（3）项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

暂停基金的赎回，基金管理人应根据《信息披露办法》的有关规定及时在指定媒体上刊登暂停赎回公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

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本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者的全部赎回申请时，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基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，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；基金投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎

回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）当出现巨额赎回时，基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

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

3、巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在3个交易日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，并通过邮寄、传真、刊登公告或者通知代销机构代为告知等方式在3个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

（十一）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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，第2个工作日基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体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、如发生暂停的时间超过1日但少于两周，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》的有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告 1 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》的有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

（十二）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。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。

进行份额转托管时，基金份额持有人可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金账户注册手续。

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

（十三）定期定额投资计划

定期定额投资计划是基金申购业务的一种方式，投资者可通过向相关销售机构提交申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构在投资者指定资金账户内自动扣款并于每期约定的申购日提交基金的申购申请。定期定额投资计划并不构成对基金日常申购、赎回等业务的影响，投资者在办理相关基金定期定额投资计划的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。本基金 2009 年 12 月 29 日公告自即日起开通定期定额投资计划业务。

投资者可通过经本公司公告可办理本业务的销售机构网点及本基金管理人网上交易平台申请办理本业务。目前可办理本业务的代销机构网点仅限中国农业银行、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行、招商银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司和上海长量基金销售投资顾问有限公司的下属各代销网点及其他非现场交易方式开通此项业务。本基金管理人可根据情况增减开办该业务的销售机构，并予以公告。

1、申请方式

（1）凡申请办理本计划的投资者须首先开立本公司开放式基金账户（已开户者除外），具体开户程序请遵循各销售机构的有关规定。

（2）投资者开立基金账户后即可携带本人有效身份证件及相关业务凭证到销售机构下属各代销网点柜台申请办理本业务，具体办理程序请遵循各销售机构的规定。

2、办理时间

本业务的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购业务受理时间相同。由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资者应以各销售机构公告的时间为准。

3、申购日期

投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每期申购日，若遇非工作日则实际提交申购申请日顺延至下一个工作日（若出现顺延导致跨月申购的情形则遵循销售机构相关的业务规则进行处理），申购以实际提交申购申请日基金份额净值为基准进行计算。

4、申购费率及扣款金额

定期定额投资计划的申购费率和计费方式与日常申购费率和计费方式相同。

投资者遵循销售机构的规定并与销售机构约定每期固定扣款金额，本基金管理人及销售机构关于每月扣款金额下限的规定以相关业务公告为准。本计划不受日常申购的最低数额限制。

但基于投资者在单个交易账户最低保留余额的规定，每个工作日投资者在单个交易账户保留的本基金份额余额少于 50 份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，基金管理人有权将投资者在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。开办定期定额投资计划业务亦受本规则限制。即，如果某笔定期定额投资计划的申购申请确认后本基金单个交易账户的基金份额余额少于 50 份，且当日该账户同时有份额减少类业务被确认，则该账户保留的本基金份额（包括该部分定期定额投资确认份额）将随即被强制赎回。

个人投资者可以通过本基金管理人 e 网行办理前端收费模式下的网上直销定期定额投资业务并享受前端申购费率优惠，开通定期定额投资业务的银行卡、具体费率优惠及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

5、扣款方式

（1）销售机构将按照投资者申请时所约定的每期申购日、扣款金额提交申购申请。具体扣款方式遵循销售机构相关的业务规则，若遇非基金申购开放日则顺延至下一基金申购开放日提交申购申请，若出现顺延导致跨月申购的情形则遵循销售机构相关的业务规则进行处理；

（2）投资者须指定一个销售机构认可的有效资金账户作为每月固定扣款账户。

（3）投资者扣款账户余额不足会导致当月申购不成功，请投资者于每月申购日前在账户内按约定存足资金，以保证业务申请的成功受理。

6、交易确认

基金的注册登记机构按照本节第 3 条规则确定的基金申购申请日（T 日）的基金份额净值为基准计算申购份额。申购份额将在 T+1 工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户内，基金份额确认查询起始日为 T+2 工作日，投资者可于 T＋2 工作日（含该日）起查询申购确认情况，并可以转换出或赎回该部分基金份额。

7、变更和终止

（1）投资者变更每期申购日、扣款金额、扣款账户等，须携带本人有效身份证件及相关凭证到原销售网点申请办理业务变更，具体办理事宜遵循各销售机构的有关规定；

（2）投资者终止定期定额投资计划，须携带本人有效身份证件及相关凭证到原销售网点申请办理业务终止，具体办理事宜遵循各销售机构的有关规定；

（3）定期定额投资计划变更和终止的生效日遵循各销售机构的有关规定。

（十四）定时不定额投资计划

投资者可通过中国工商银行股份有限公司的“基智定投”办理本基金的定时不定额投资业务。

基智定投业务是中国工商银行股份有限公司普通基金定投业务的升级业务，基智定投分为定时不定额和定时定额两种投资方式。

定时不定额投资方式：投资者可以每月固定日期、并根据证券市场指数的走势不固定金额进行定时不定额投资，实现对基金投资时点和金额的灵活控制。

定时定额投资方式：投资者可以每月固定日期、固定金额进行定时定额投资。

有关该业务的详情请参阅本基金管理人 2010 年 1 月 25 日发布的《关于旗下交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金在中国工商银行股份有限公司开办定期定额投资业务的公告》。

投资者通过中国工商银行股份有限公司办理本公司旗下基金的基智定投业务，相关流程和业务规则遵循中国工商银行股份有限公司的有关规定。详情请咨询当地中国工商银行股份有限公司的代销网点或中国工商银行股份有限公司客户服务电话（95588）。

（十五）定期定额赎回业务

投资者可通过中国农业银行申请办理本基金的定期定额赎回业务。定期定额赎回业务是指投资者可以委托中国农业银行每月固定时间从指定的基金账户代投资者赎回固定份额的基金。本基金 2009 年 12 月 29 日刊登公告自即日起在中国农业银行下属各代销网点开通定期定额赎回业务。

本业务的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购、赎回业务受理时间相同，为开放日的 9：30—15：00。

本业务的赎回费率和计费方式与日常赎回费率和计费方式相同。

办理定期定额赎回业务时，投资者可与中国农业银行约定每月固定赎回份额，每月赎回份额不低于 100 份（含 100 份）。

投资者通过中国农业银行办理本基金的定期定额赎回业务，相关流程和业务规则遵循中国农业银行的有关规定。详情请咨询当地中国农业银行的代销网点或中国农业银行客户服务热线（95599）。

（十六）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。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基金投资者。

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注册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注册登记机构的规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

（十七）基金的冻结和解冻

基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回、转换出申请、非交易过户以及基金的转托管。

九、基金的转换

（一）基金转换

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

（二）转换业务办理地点

投资者可以通过本公司直销中心及网上交易平台和中国农业银行、中国建设银行股份有限公司、交通银行、招商银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司和上海长量基金销售投资顾问有限公司的相关营业网点及其他非现场交易方式办理本基金的转换业务。如上述业务办理机构发生变动，本公司将按照规定在指定媒体上另行公告。

一般而言，上述代销机构中未代销本公司旗下所有基金的，则只办理该机构所代销的本公司旗下基金之间已开通的转换业务。此外，本公司网上交易平台和北京银行股份有限公司仅办理部分已开通的基金转换业务，具体见 2011 年 5 月 27

日本公司发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于开通旗下部分基金基金转换业务及调整基金转换业务规则的公告》及其他相关公告。

（三）转换业务办理时间

办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资者应以各销售机构公告的时间为准。

（四）转换业务适用的基金范围

目前本基金管理人旗下管理的基金包括交银施罗德精选股票证券投资基金（基金代码：前端 519688，后端 519689；以下简称“交银精选”）、交银施罗德货币市场证券投资基金（基金代码：A 级 519588，B 级 519589；以下简称“交银货币”）、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金（基金代码：前端 519690，后端 519691；以下简称“交银稳健”）、交银施罗德成长股票证券投资基金（基金代码：前端 519692，后端 519693；以下简称“交银成长”）、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金（基金代码：前端 519694，后端 519695；以下简称“交银蓝筹”）、交银施罗德增利债券证券投资基金（基金代码：A 类基金份额：519680；B 类基金份额：519681；C 类基金份额：519682；以下简称“交银增利”）、交银施罗德环球精选价值证券投资基金（基金代码：519696；以下简称“交银环球”）、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：519697；以下简称“交银行业”）、交银施罗德先锋股票证券投资基金（基金代码：前端 519698，后端 519699；以下简称“交银先锋”）、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金（基金二级市场交易代码：510010；以下简称“治理 ETF”）、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金代码：前端 519686，后端 519687；以下简称“交银治理”）、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：前端 519700，后端 519701；以下简称“交银主题”）、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金（基金代码：前端 519702，后端 519703；以下简称“交银趋势”）、交银施罗德信用添利债券证券投资基金（基金代码：164902；以下简称“交

银添利”)、交银施罗德先进制造股票证券投资基金（基金代码：前端 519704，后端 519705；以下简称“交银制造”)、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159913；以下简称“交银深证 300 价值 ETF”)、交银施罗德双利债券证券投资基金（基金代码：A 类基金份额：519683；B 类基金份额：519684；C 类基金份额：519685；以下简称“交银双利”)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金代码：前端 519706，后端 519707；以下简称“交银价值”)、交银施罗德全球自然资源证券投资基金（基金代码：519709；以下简称“交银资源”)、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金（基金代码：519710；以下简称“交银荣安保本”）和交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金（基金代码：前端 519712，后端 519713；以下简称“交银核心”)。上述基金已开通转换业务的范围如下表所示：

转入基金 / 转出基金	前端收费模式下股票基金和混合基金	后端收费模式下股票基金和混合基金	交银增利/双利 A 类基金份额	交银增利/双利 B 类基金份额	交银增利/双利 C 类基金份额	交银货币
前端收费模式下股票基金和混合基金	已开通	—	已开通	—	已开通	已开通
后端收费模式下股票基金和混合基金	—	已开通	—	已开通	已开通	已开通
交银双利/增利 A 类基金份额	已开通	—	已开通	—	已开通	已开通
交银双利/增利 B 类基金份额	—	已开通	—	已开通	已开通	已开通

交银双利/增利 C 类基金份额	已开通	已开通	已开通	已开通	已开通	已开通
交银货币	已开通	已开通	已开通	已开通	已开通	—

注：1、同一基金的 A 类、B 类和 C 类基金份额之间不可转换。

2、表格中分别列示的前后端收费模式下的股票基金和混合基金包括交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值和交银核心。表格中列示的前端收费模式下的股票基金和混合基金还包括交银行业和交银荣安保本。

3、交银环球、治理 ETF、交银添利、交银深证 300 价值 ETF 和交银资源的基金转换业务暂不开通。本公司今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于上述业务。

如果未来开通本基金与本基金管理人旗下其他基金之间的转换业务，基金管理人将及时公告。和其他基金有关的转换规定，以届时公告为准。

（五）基金转换的程序

1、申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。

2、基金转换申请的确认

正常情况下，T 日规定时间受理的申请，基金注册登记机构在 T＋1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后(包括该日)投资者可向销售机构查询转换的确认情况。

3、基金转换的注册登记

注册登记机构以收到有效转换申请的当天作为转换申请日（T 日）。投资者转换基金成功的，注册登记机构将在 T＋1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认，办理转出基金的权益扣除以及转入基金的权益登记，在 T＋2 日后（包括该日）投资者可向销售机构查询基金转换的成交情况，并有权转换或赎回该部分基金份额。

（六）基金转换的数额限制

基金转换以份额为单位进行申请，申请转换份额精确到小数点后两位，小数

点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

本基金遵循“份额转换”的原则，单笔转换份额不得低于 200 份。基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

基于投资者在单个交易账户最低保留余额的规定，每个工作日投资者在单个交易账户保留的本基金份额余额少于 50 份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，基金管理人有权将投资者在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。因此，如果某笔转换申请确认后转出基金的单个交易账户的基金份额余额少于50份，则转出基金在该账户剩余的基金份额将被全部赎回。如果某笔转换申请确认后转入基金的单个交易账户的基金份额余额少于50份且该账户当日有份额减少类业务被确认，则转入基金在该账户剩余的基金份额（包括该部分转换入确认份额）将随即被强制赎回。

（七）基金转换费用

1、每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用相应由转出基金的赎回费用及转出与转入基金的申购补差费用构成。

2、转出基金的赎回费用

转出交银货币、交银增利 C 类基金份额或交银双利 C 类基金份额不收取赎回费用；转出交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银行业、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银荣安保本、交银核心、交银增利 A 类、B 类基金份额和交银双利 A 类、B 类基金份额收取赎回费用，赎回费用的 25%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，上述转出基金的赎回费率具体如下：

转出基金	转出份额持有时间	赎回费率
交银荣安保本	1 年以内（含）	2.0%
	1 年至 2 年（含）	1.6%
	2 年至 3 年	1.2%
	持有到保本周期到期日	0
交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银行业、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	1 年（含）以内	0.5%
	1 年-2 年（含）	0.2%
	2 年以上	0
交银增利 A 类、B 类基金份额	1 年（含）以内	0.1%

交银双利 A 类、B 类基金份额	1 年-2 年（含）	0.05%
	2 年以上	0

3、前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转换，不收取申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应分档的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行补差，转出与转入基金的申购补差费率按照转出确认金额分档，并随着转出确认金额递减。前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费率具体如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的申购补差费率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值、交银核心	50 万元以下	1.5%
		50 万元（含）至 100 万元	1.2%
		100 万元（含）至 200 万元	0.8%
		200 万元（含）至 500 万元	0.5%
		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银荣安保本	50 万元以下	1.0%
		50 万元（含）至 100 万元	0.8%
		100 万元（含）至 200 万元	0.6%
		200 万元（含）至 500 万元	0.4%
		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银行业、交银趋势	100 万元以下	1.5%
		100 万元（含）至 500 万元	1.0%
		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金	交银双利 A 类基金份额 交银增利 A 类基金份额	50 万元以下	0.8%
		50 万元（含）至 100 万元	0.6%
		100 万元（含）至 200 万元	0.5%
		200 万元（含）至 500 万元	0.3%

份额		500 万元以上（含 500 万）	每笔交易 1000 元
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值、交银核心	50 万元以下	0.7%
		50 万元（含）至 100 万元	0.6%
		100 万元（含）至 200 万元	0.3%
		200 万元（含）至 500 万元	0.2%
		500 万元以上（含 500 万）	0
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	前端收费模式下交银荣安保本	100 万元以下	0.2%
		100 万元（含）至 500 万元	0.1%
		500 万元以上（含 500 万）	0
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	前端收费模式下交银行业、交银趋势	100 万元以下	0.7%
		100 万元（含）至 500 万元	0.5%
		500 万元以上（含 500 万）	0
前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银行业、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	交银货币 交银增利 A 类、C 类基金份额 交银双利 A 类、C 类基金份额 前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银行业、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银荣安保本、交银核心	-	0
交银荣安保本	交银货币 交银增利 A 类、C 类基金份额 交银双利 A 类、C 类基金份额	-	0
交银荣安保本	前端收费模式下交银行业、交银趋势	100 万元以下	0.5%
		100 万元（含）至 500 万元	0.4%
		500 万元以上（含 500 万）	0
交银荣安保本	前端收费模式下交银精选、交银稳	50 万元以下	0.5%
		50 万元（含）至 100 万元	0.4%
		100 万元（含）至 200 万元	0.2%

	健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值，交银核心	200 万元（含）至 500 万元	0.1%
		500 万元以上（含 500 万）	0
交银增利 A 类、C 类基金份额 交银双利 A 类、C 类基金份额	交银货币	-	0
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	交银双利 A 类基金份额 交银增利 A 类基金份额	-	0
交银增利 A 类基金份额 交银双利 A 类基金份额	交银双利 C 类基金份额 交银增利 C 类基金份额	-	0
交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	交银双利 C 类基金份额 交银增利 C 类基金份额	-	0
交银货币	交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	-	0

备注：同一基金的 A 类、C 类基金份额之间不可转换。

4、后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或无申购费用的交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费率具体如下：

转出基金	转入基金	转出份额持有时间	转出与转入基金的申购补差费率

交银货币 交银增利 B 类、C 类基金份额 交银双利 B 类、C 类基金份额 后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	—	0
交银货币	交银增利 B 类基金份额 交银双利 B 类基金份额	—	0
后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	1 年（含）以内	1.8%
		1 年-3 年（含）	1.2%
		3 年-5 年（含）	0.6%
		5 年以上	0
后端收费模式下 交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银趋势、交银制造、交银价值、交银核心	交银增利 B 类基金份额 交银双利 B 类基金份额	1 年（含）以内	0.8%
		1 年-3 年（含）	0.6%
		3 年-5 年（含）	0.2%
		5 年以上	0
交银增利 B 类基金份额 交银双利 B 类基金份额	交银货币 交银双利 C 类基金份额 交银增利 C 类基金份额	1 年（含）以内	1.0%
		1 年-3 年（含）	0.6%
		3 年-5 年（含）	0.4%
		5 年以上	0
交银增利 B 类基金份额 交银双利 B 类基金份额	交银双利 B 类基金份额 交银增利 B 类基金份额	-	0
交银增利 C 类基金	交银双利 B 类基金份	-	0

份额 交银双利 C 类基金份额	额 交银增利 B 类基金份额		

备注：同一基金的 B 类、C 类基金份额之间不可转换。

5、“e 网行”网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通基金网上直销业务，已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。目前，投资者可通过 e 网行办理公司旗下部分基金的转换业务，其中部分转换可享受前端收费模式下转出与转入基金申购补差的费率优惠，转出基金的赎回费用无优惠。

网上直销基金转换费率优惠业务仅针对以下范围：

（1）交银货币、交银增利 C 类基金份额、交银双利 C 类基金份额转入前端收费模式下的交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值、交银核心，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费率	转出与转入基金的优惠申购补差费率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银精选、交银稳健、交银成长、交银蓝筹、交银先锋、交银治理、交银主题、交银制造、交银价值、交银核心	50 万元以下	1.5%	0.6%
		50 万元（含）至 100 万元	1.2%	0.6%
		100 万元（含）至 200 万元	0.8%	0.6%

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 200 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

（2）交银货币、交银增利 C 类基金份额、交银双利 C 类基金份额转入前端收费模式下的交银行业，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费	转出与转入基金的优惠申购补差费

			率	率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银行业	100 万元以下	1.5%	0.6%
		100 万元（含）至 500 万元	1.0%	0.6%

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 500 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

（3）交银货币、交银增利 C 类基金份额、交银双利 C 类基金份额转入前端收费模式下的交银荣安保本，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费率	转出与转入基金的优惠申购补差费率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	前端收费模式下交银荣安保本	50 万元以下	1.0%	0.6%
		50 万元（含）至 100 万元	0.8%	0.6%

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 100 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

（4）交银货币、交银增利 C 类基金份额和交银双利 C 类基金份额转入交银双利 A 类基金份额和交银增利 A 类基金份额，享受转出与转入基金的申购补差费率优惠如下：

转出基金	转入基金	转出确认金额	转出与转入基金的日常申购补差费率	转出与转入基金的优惠申购补差费率
交银货币 交银增利 C 类基金份额 交银双利 C 类基金份额	交银双利 A 类基金份额 交银增利 A 类基金份额	50 万元以下	0.8%	0.6%

备注：同一基金的 A 类、C 类基金份额之间不可转换。

通过 e 网行进行上述基金转换单笔转换金额超过 50 万元（含）的不享受转出与转入基金的申购补差费率优惠，按照日常转出与转入基金的申购补差费率执行。

6、转出基金的赎回费用和已开通的其它基金转换业务的转出与转入基金的申购补差费率与网下（柜台模式）日常费率相同，不享受优惠。

7、基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定对上述收费方式和费率进行调整，并应于调整后的收费方式和费率在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

（八）基金转换份额的计算公式

1、前端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率/（1+对应的转出与转入基金的申购补差费率）

（注：对于适用固定金额申购补差费用的，转出与转入基金的申购补差费＝固定金额的申购补差费）

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A 为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益(仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则 A 为 0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

例一：某投资者持有交银趋势前端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期半年，转换申请当日交银趋势的基金份额净值为 1.010 元，交银成长的基金份额净值为 2.2700 元。若该投资者将 100,000 份交银趋势前端基金份额转换为交银成长前端基金份额，则转入交银成长确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.010=101,000 元

转出基金的赎回费=101,000×0.5%=505 元

转入确认金额=101,000-505=100,495 元

转出与转入基金的申购补差费=100,495×0/（1+0）=0 元

转入基金确认份额=（100,495-0）/2.2700=44,270.93 份

例二：某投资者持有交银增利 A 类基金份额 1,000,000 份，持有期一年半，转换申请当日交银增利 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0200 元，交银趋势的基金份额净值为 1.010 元。若该投资者将 1,000,000 份交银增利 A 类基金份额转换为交银趋势前端基金份额（不通过“e 网行”），则转入交银趋势确认的基金份额为：

转出确认金额=1,000,000×1.0200=1,020,000 元

转出基金的赎回费=1,020,000×0.05%=510 元

转入确认金额=1,020,000-510=1,019,490 元

转出与转入基金的申购补差费=1,019,490×0.5%/（1+0.5%）=5,072.09 元

转入基金确认份额=（1,019,490-5,072.09）/1.010=1,004,374.17 份

例三：某投资者持有交银增利 C 类基金份额 100,000 份，转换申请当日交银增利 C 类基金份额净值为 1.2500 元，交银精选的基金份额净值为 2.2700 元。若该投资者将 100,000 份交银增利 C 类基金份额转换为交银精选前端基金份额（不通过“e 网行”），则转入交银精选确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.2500=125,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=125,000-0=125,000 元

转出与转入基金的申购补差费=125,000×1.5%/（1+1.5%）=1,847.29 元

转入基金确认份额=（125,000-1,847.29）/2.2700=54,252.30 份

例四：某投资者持有交银货币 A 级基金份额 100,000 份，该 100,000 份基金份额未结转的待支付收益为 61.52 元，转换申请当日交银增利 A/B 类基金份额净值为 1.2700 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银货币 A 级基金份额转换为交银增利 A 类基金份额（不通过“e 网行”），则转入确认的交银增利 A 类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=100,000-0=100,000 元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0.8%/（1+0.8%）=793.65 元

转入基金确认份额=（100,000-793.65+61.52）/1.2700=78,163.68 份

2、后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A 为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益(仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则 A 为 0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

例五：某投资者持有交银主题后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期一年半，转换申请当日交银主题的基金份额净值为 1.2500 元，交银稳健的基金份额净值为 2.2700 元。若该投资者将 100,000 份交银主题后端基金份额转换为交银稳健后端基金份额，则转入交银稳健确认的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000 元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×0=0 元

转入基金确认份额=（124,750-0）/2.2700=54,955.95 份

例六：某投资者持有交银先锋后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期一年半，转换申请当日交银先锋的基金份额净值为 1.2500 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银先锋后端基金份额转换为交银货币，则转入交银货币的基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.250=125,000 元

转出基金的赎回费=125,000×0.2%=250 元

转入确认金额=125,000-250=124,750 元

转出与转入基金的申购补差费=124,750×1.2%=1497 元

转入基金确认份额=（124,750-1497）/1.00=123,253.00 份

例七：某投资者持有交银蓝筹后端收费模式的基金份额 100,000 份，持有期三年半，转换申请当日交银蓝筹的基金份额净值为 0.8500 元，交银增利 B 类基金份额的基金份额净值为 1.0500。若该投资者将 100,000 份交银蓝筹后端基金份额转换为交银增利 B 类基金份额，则转入交银增利 B 类基金份额的基金份额为：

转出确认金额=100,000×0.850=85,000 元

转出基金的赎回费=85,000×0=元

转入确认金额=85,000-0=85,000 元

转出与转入基金的申购补差费=85,000×0.2%=170 元

转入基金确认份额=（85,000-170）/1.0500=80,790.48 份

例八：某投资者持有交银货币 A 级基金份额 100,000 份，该 100,000 份基金份额未结转的待支付收益为 61.52 元，转换申请当日交银增利 B 类基金份额净值为 1.2700 元，交银货币的基金份额净值为 1.00 元。若该投资者将 100,000 份交银货币 A 级基金份额转换为交银增利 B 类基金份额，则转入确认的交银增利 B 类基金份额为：

转出确认金额=100,000×1.00=100,000 元

转出基金的赎回费=0 元

转入确认金额=100,000-0=100,000 元

转出与转入基金的申购补差费=100,000×0=0 元

转入基金确认份额=（100,000-0+61.52）/1.2700=78,788.60 份

（九）业务规则

1、基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的基金。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

2、投资者只能在相同收费模式下进行基金转换。前端收费模式的开放式基金只能转换到前端收费模式的其他基金，后端收费模式的基金只能转换到后端收费模式的其他基金。交银货币、交银增利 C 类基金份额、交银双利 C 类基金份额与其他基金之间的转换不受上述收费模式的限制。

3、基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以申请受理当日各转出、转入基金的基金份额净值为基础进行计算。（货币市场基金的基金份额净值为固定价 1.00 元）。

4、投资者申请转出其账户内交银货币的基金份额时，注册登记机构将自动结转该转出份额对应的待支付收益，该收益将一并计入转出金额并折算为转入基金的基金份额，但收益部分不收取转换费用。

5、转换后，转入基金份额的持有时间将重新计算，即转入基金份额的持有期将自转入基金份额被确认日起重新开始计算。

6、根据交银荣安保本基金合同的约定，基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额，以及在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额不适用保本条款，其赎回或转换价格以赎回或转换申请日的基金份额净值为基准进行计算。

（十）暂停基金转换

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回的情形和公告的有关规定一般也适用于暂停基金转换，具体暂停或恢复基金转换的相关业务请详见届时本基金管理人发布的相关公告。

单个开放日，基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额加上基金转换中转出申请总份额后扣除申购申请总份额及基金转换中转入申请总份额后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但在转出申请得到部分确认的情况下，未确认部分的转出申请将自动予以撤销，不再视为下一开放日的基金转换申请。

十、基金的投资

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

（二）投资理念

本基金遵循指数化投资理念，以目标 ETF 为主要投资对象，帮助投资者以较低的成本获取与标的指数和目标 ETF 同步的收益。

（三）目标 ETF 的投资

本基金的目标 ETF 为上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金，经 2009 年 8 月 17 日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】795 号文核准募集。

目标 ETF 投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

目标 ETF 的投资范围、投资策略以及投资组合管理等具体内容以目标 ETF 基金合同和招募说明书列示为准。

（四）投资范围

本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

（五）投资策略

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资均进行被动式指数化投资。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种（如股指期货等），基金

管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、决策和交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会的主要职责是决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。

基金经理的主要职责是决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策，特别是对目标 ETF 份额的投资决策。

中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估及组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：量化投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标 ETF 二级市场的流动性和折溢价分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，以作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据量化投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理构建以目标 ETF 为主的证券组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）绩效评估：量化投资部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资

策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪目标 ETF 及标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

（六）投资组合管理

由于本基金的特殊性，本基金将以全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF。正常情况下本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，剩余资产除流动性管理所需以外，均进行被动式指数化投资。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后，如因证券市场波动、基金规模变动等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

1、投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人首先根据基金规模确定目标 ETF 的持有量，剩余资产，除流动性管理所需以外，均进行被动式指数化投资管理。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司行为、基本面等因素的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：基金经理在规定时间内采用适当的手段构建和调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

2、日常投资组合管理

(1)对目标 ETF 二级市场流动性及折溢价进行跟踪与分析，适当制订目标 ETF 份额的申购赎回、二级市场买卖策略。

（2）跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响，并进行相应的流动性管理。

（3）本基金直接投资于标的指数成份股和备选成份股的部分，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。

3、投资绩效评估

（1）每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

（2）每月末，量化投资部对本基金的运行情况进行量化评估。

（3）每月末，基金经理根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。在目标 ETF 日均跟踪偏离度符合其基金合同所设定目标的前提下，如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

（七）标的指数

本基金的标的指数即目标 ETF 的标的指数，为上证 180 公司治理指数。

上证 180 公司治理指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证 180 公司治理指数的所有权归属上海证券交易所。

本基金按照基金合同的约定通过适当程序变更目标 ETF 时，标的指数应相应变更。

（八）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：标的指数×95%＋银行活期存款税后收益率×5%。

本基金标的指数变更的，业绩比较基准随之变更并公告。

（九）风险收益特征

本基金属 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

（十）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(2)本基金参与股票发行申购，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；

(3)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(4)本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(5)本基金持有的资产支持证券的信用级别均在BBB级以上。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%；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，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%。

(6)本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(7)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)项以及(3)-(6)项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（十一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、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，但是国务院另有规定和指定的目标 ETF 除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但指定的目标 ETF 除外；

7、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；

8、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

（十二）目标 ETF 的变更

当出现以下情形时，基金管理人可以在履行适当的程序后变更本基金所联接的目标 ETF，以与原目标 ETF 有类似投资目标的 ETF 作为新的目标 ETF：

（1）目标 ETF 的基金合同终止；

（2）目标 ETF 与其他基金进行合并；

（3）目标 ETF 变更标的指数；

（4）目标 ETF 的基金管理人或基金托管人发生变更；

（5）中国证监会规定的其他情形。

（十三）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

（十四）基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

（十五）基金投资组合报告

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

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2012 年 10 月 25 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。

本投资组合报告期为 2012 年 7 月 1 日至 2012 年 9 月 30 日，所载财务数据未经审计师审计。

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	30,792,122.29	1.18
	其中：股票	30,792,122.29	1.18
2	基金投资	2,452,901,175.00	93.69
3	固定收益投资	116,879,600.00	4.46
	其中：债券	116,879,600.00	4.46
	资产支持证券	-	-
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	15,473,328.03	0.59
7	其他各项资产	1,942,077.47	0.07
8	合计	2,617,988,302.79	100.00

2、期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	上证180公司治理交易型开	股票型	交易型开放式	交银施罗德基金管理有限公	2,452,901,175.00	93.76

	放式指数证券投资基金			司		

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	3,251,591.06	0.12
C	制造业	5,996,372.73	0.23
C0	食品、饮料	212,155.06	0.01
C1	纺织、服装、皮毛	137,802.65	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	207,170.96	0.01
C5	电子	206,996.55	0.01
C6	金属、非金属	1,813,157.63	0.07
C7	机械、设备、仪表	2,379,556.05	0.09
C8	医药、生物制品	1,039,533.83	0.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	949,455.16	0.04
E	建筑业	1,358,239.21	0.05
F	交通运输、仓储业	1,158,332.17	0.04
G	信息技术业	685,470.91	0.03
H	批发和零售贸易	381,791.41	0.01
I	金融、保险业	15,210,808.44	0.58
J	房地产业	1,579,262.45	0.06
K	社会服务业	48,131.90	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	172,666.85	0.01

	合计	30,792,122.29	1.18

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	46,388	1,945,512.72	0.07
2	600016	民生银行	312,725	1,766,896.25	0.07
3	600036	招商银行	171,212	1,739,513.92	0.07
4	601166	兴业银行	104,537	1,255,489.37	0.05
5	600000	浦发银行	154,955	1,143,567.90	0.04
6	600030	中信证券	95,351	1,124,188.29	0.04
7	600837	海通证券	112,036	1,073,304.88	0.04
8	601088	中国神华	45,664	1,050,728.64	0.04
9	601601	中国太保	43,520	880,409.60	0.03
10	601398	工商银行	214,131	802,991.25	0.03

5、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	116,879,600.00	4.47
	其中：政策性金融债	116,879,600.00	4.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	116,879,600.00	4.47

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净

号					值比例（%）
1	120228	12国开28	470,000	46,849,600.00	1.79
2	120218	12国开18	400,000	40,028,000.00	1.53
3	100229	10国开29	200,000	19,994,000.00	0.76
4	120216	12国开16	100,000	10,008,000.00	0.38

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

本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	17,942.20
4	应收利息	1,631,442.02
5	应收申购款	42,693.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,942,077.47

（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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2012 年 9 月 30 日，所载财务数据未经审计师审计。

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

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

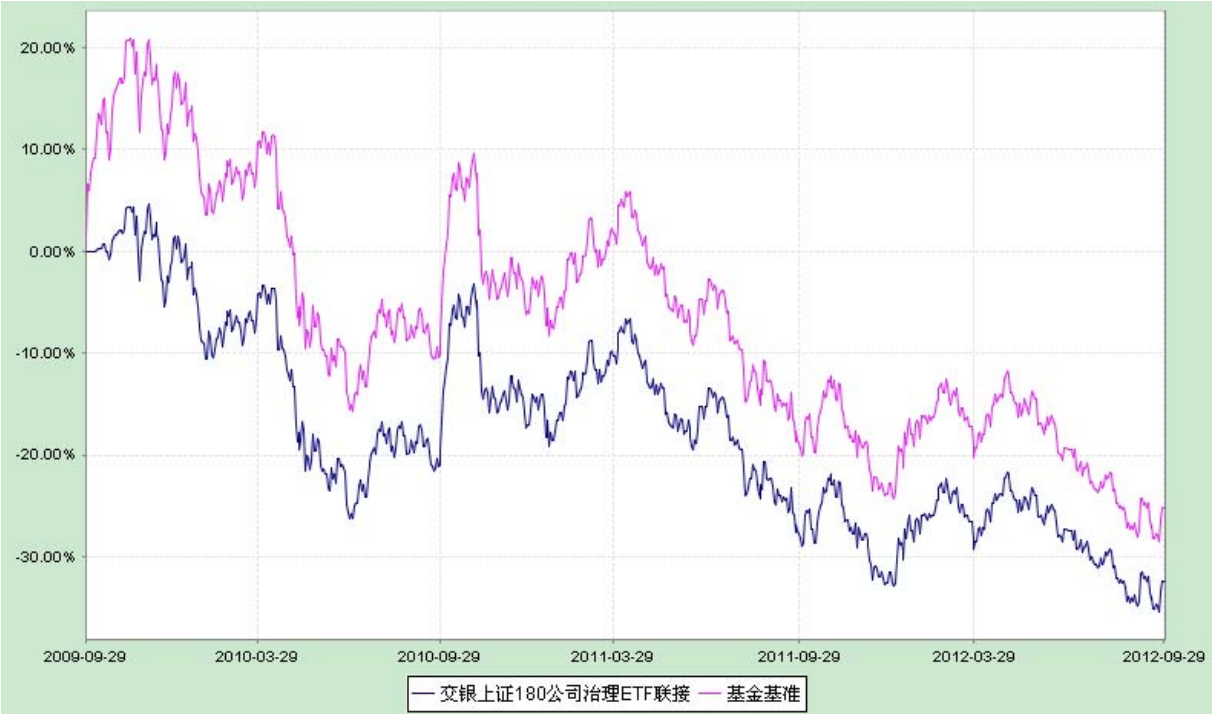
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.02%	1.12%	-7.33%	1.08%	0.31%	0.04%
2012年度上半年	6.13%	1.23%	4.54%	1.22%	1.59%	0.01%
2011年度	-18.74%	1.26%	-19.15%	1.25%	0.41%	0.01%
2010年度	-16.95%	1.49%	-18.77%	1.50%	1.82%	-0.01%
2009年度（2009年9月29日至2009年12月31日）	1.50%	1.23%	17.55%	1.68%	-16.05%	-0.45%

2、自基金合同生效以来基金份额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

交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

份额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

（2009 年 9 月 29 日至 2012 年 9 月 30 日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 3 个月。截至建仓期结束及 2012 年 9 月 30 日，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的包括目标 ETF 份额在内的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的金额。

（三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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）基金财产的保管与处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，并为基金份额提供计价依据。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（四）估值方法

1、目标 ETF 估值方法：

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

2、股票估值方法：

（1）上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（2）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映

其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值办法：

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）－（3）项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）－（3）项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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

的差额部分支付给差错责任方；

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值差错处理的原则和方法

（1）当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，

有权向其他当事人追偿。

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

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

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

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

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

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

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

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、基金所投资之目标 ETF 发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形；

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

4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投

资者的利益，已决定延迟估值；

5、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十四、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

1、买卖证券差价；

2、基金投资所得红利、股息、债券利息；

3、投资目标 ETF 份额所得收益；

4、银行存款利息；

5、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金利润扣除按国家有关规定可以在基金利润中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；

3、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

4、本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 10%；基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算。收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现利润的孰低数；

5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为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；

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配的时间和程序

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2、在分配方案公布后，依据具体方案的规定，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

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

（六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

（七）收益分配方式的修改

投资者可至销售机构办理收益分配方式的修改，投资者对不同的交易账户可设置不同的收益分配方式。投资者同一日多次申报分红方式变更的，按照《业务规则》执行，最终确认的分红方式以注册登记机构记录为准。

十五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后的信息披露费用；

4、基金份额持有人大会费用；

5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

6、基金的证券交易费用；

7、基金财产拨划支付的银行费用；

8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0）的 0.5%年费率计提基金管理费。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提基金托管费。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）上述(一)中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

（2）赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

（3）转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的转换”一章。

（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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（四）基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率、基金托管费率或改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定在新的费率或收费模式实施日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十六、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会计责任方；

2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、本基金的会计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的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

（二）基金的审计

1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒体上公告。

十七、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

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、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，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。

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份额销售机构；

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，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。

（一）公开披露的基金信息

1、招募说明书、基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1)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，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(2)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。

(3)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。

2、基金份额发售公告

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

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定报刊及基金管理人网站上公告。

5、基金资产净值、基金份额净值公告

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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和基金管理人网站上。

6、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在本基金的基金合同、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份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上。

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

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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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；

(2)终止基金合同；

(3)转换基金运作方式；

(4)更换基金管理人、基金托管人；

(5)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

(6)基金管理人股东及其出资比例发生变更；

(7)基金募集期延长；

(8)基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

(9)基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

(10)基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；

(11)涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

(12)基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(13)基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

(14)重大关联交易事项；

(15)基金收益分配事项；

(16)管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17)基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

(18)基金改聘会计师事务所；

(19)基金变更、增加或减少场外代销机构；

(20)基金更换注册登记机构；

(21)本基金开始办理申购、赎回；

(22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(23)本基金发生巨额赎回并延期支付；

(24)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

(25)本基金暂停接受申购、赎回申请；

(26)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；

(27)基金推出新业务或服务；

(28)中国证监会规定的其他事项。

9、澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，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。

10、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核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

11、中国证监会规定的其他信息。

（二）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，指定专人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、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

（三）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，应当分别置备于基金管理人处、基金托管人处，供公众查阅，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十八、风险揭示

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

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请（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）超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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

因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以 1 元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值或 1 元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，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）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

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，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

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

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

（四）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

（五）投资本基金的特有风险

1、目标ETF的风险

本基金为ETF联接基金，主要投资对象是目标ETF，因此目标ETF面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

2、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

3、标的指数波动的风险

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

4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

（1）本基金90%以上的净资产投资于目标ETF，目标ETF回报与标的指数回报的偏离会造成本基金与标的指数的跟踪偏离；

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

（3）受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标ETF份额和成份股、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将目标ETF份额和成份股及时地转化为现金，使得本基金在跟踪标的指数时存在一定的跟踪偏离风险；

（4）在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力，

例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出证券的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金相对于对标的指数的偏离程度。

5、本基金为目标 ETF 的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生差异的原因包括以下几个方面：

（1）本基金赎回采用现金方式，为支付现金赎回款，相比目标 ETF，本基金需要保留更多的现金资产；

（2）本基金申购采用现金方式，在利用到账的申购资金投资目标 ETF 过程中，市场波动等原因会造成本基金与目标 ETF 表现的差异；

（3）本基金为应对现金申购赎回而进行的证券交易需支付一定的手续费，此等费用将影响本基金相对于目标 ETF 的表现。

（六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

3、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；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

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

7、其他意外导致的风险。

十九、基金合同的终止与基金财产的清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；

3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

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

3、基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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：

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

(1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2)对基金财产进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估价和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(7)将基金清算结果报告中国证监会；

(8)公布基金清算报告；

(9)对基金剩余财产进行分配。

（三）清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

（四）基金财产的清偿、分配顺序

基金财产按照下列顺序清偿和分配：

1、支付清算费用；

2、交纳所欠税款；

3、清偿基金债务；

4、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1-3项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（六）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

（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。

二十、基金合同内容摘要

（一）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）获得基金管理人报酬；

（3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（4）在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率、管理费率和赎回费率之外的费率结构和收费方式；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

（6）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

（7）自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（8）选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（10）依法召集基金份额持有人大会；

（11）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；

（12）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金融资、融券；

（13）法律法规规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

（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、勤勉尽责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财产分别管理，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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）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；

（10）按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）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；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（15）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；

（16）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；

（17）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；

（18）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；

（19）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；

（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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人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托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）建立并保存基金份额持有人名册；

（24）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；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；

（27）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（28）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

3、基金托管人的权利

（1）获得基金托管费；

（2）自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

（3）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

（4）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

（5）依法召集基金份额持有人大会；

（6）按规定取得基金份额持有人名册；

（7）法律法规规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

（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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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；

（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应予保密，不得向他人泄露；

（8）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；

（10）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；

（11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（13）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）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；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召

集基金份额持有人大会；

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

（18）按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（19）根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

（20）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

（22）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（23）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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）依法转让或者根据基金合同约定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本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会，对本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务包括但不限于：

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人

的义务包括但不限于：

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

（3）在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；

（4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

（5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

（7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

（二）基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(“以上”含本数，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

1)终止基金合同；

2)转换基金运作方式；

3)变更基金类别、投资目标、投资范围或投资策略；

4)变更基金份额持有人大会议事程序；

5)更换基金管理人、基金托管人；

6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准以及赎回费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

7)本基金与其他基金的合并；

8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

9)基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会；

10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

（2）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

1)调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

3)因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须做出相应变动的；

4)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

5)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

6)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；

7)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、召集人和召集方式

（1）除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

（2）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，应当自行召集。

（3）代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

（4）代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（5）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。

4、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）基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须至少于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

1)会议召开的时间、地点和出席方式；

2)会议拟审议的主要事项；

3)会议形式；

4)议事程序；

5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

6)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；

7)表决方式；

8)会务常设联系人姓名、电话；

9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10)召集人需要通知的其他事项。

（2）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表达意见的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书面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书面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书面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，不影响计票和表决结果。

5、基金份额持有人出席会议的方式

（1）会议方式

1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2)现场开会由基金份额持有人本人出席或授权委托委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

（2）召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

②亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证及身份证明和受托出席会议者身份证明及其出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托证明等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 25 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关

提示性公告；

②召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人；以下称为“监督人”)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，监督人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

④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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

6、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

3)对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集

人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

（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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表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。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 日在公证机构及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公正机关监督下形成的决议有效。

（3）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。

7、决议形成的条件、表决方式、程序

（1）基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

（2）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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列 2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

（3）基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

（4）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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

（5）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（6）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。

8、计票

（1）现场开会

1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3)如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4)计票过程应由公证机关予以公证。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人的监督下进行计票，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。关于本章第 2 款所规定的第 1)-7)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本条第 2 款所规定的第 8)、9)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

（2）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。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定。

（3）基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。

（4）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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

10、鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会。

11、法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金合同的变更与终止

1、基金合同的变更

（1）下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

1)转换基金运作方式；

2)变更基金类别，投资目标、投资范围或投资策略；

3)变更基金份额持有人大会议事程序；

4)更换基金管理人、基金托管人；

5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准以及赎回费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

6)本基金与其他基金的合并；

7)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会

的变更基金合同等其他事项；

8)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

1)调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

3)因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须做出相应变动的；

4)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

5)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

6)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；

7)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（2）关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体公告。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；

（3）基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（四）争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决

是终局的，对当事人均有约束力。

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人处、基金托管人处查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十一、托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼

邮政编码：200120

法定代表人：钱文挥

成立日期：2005年8月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】128号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

2、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

邮政编码：100031

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资金：32,479,411.7万元人民币

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；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理

资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、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和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为：本基金以目标ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

2、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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（2）本基金参与股票发行申购，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；

（3）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（4）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金

资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(5)本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上。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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%;基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

（6）本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

（7）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、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 1 项以及 3-6 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项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交易证券名单。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并协助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。

4、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。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进行更新，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，应向基金托管人说明理由，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。基金管理人收到基金托管人以双方约定方式完成确认后，被确认调整的名单开始生效，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。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，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，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。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。

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

6、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、

行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

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

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1、基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨

碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

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

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

2、基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间的资金应存于中国证券登记结算有限责任公司。该账户由基金管理人委托的注册登记机构开立并管理。

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

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

3、基金资金账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

（2）基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

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

（4）基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

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

5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，

并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

6、其他账户的开立和管理

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

8、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管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

（五）基金资产估值、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算及复核程序

（1）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核后按规定公告。

（2）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对外公布。

2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

（1）估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（2）估值方法

1）目标 ETF 估值方法：

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

2）股票估值方法：

①上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

②未上市股票的估值。

a.首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

b.送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

c.首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

d.非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

③在任何情况下，基金管理人如采用本项第①－②小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第①－②小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估

值；

④国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3）债券估值办法：

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

④交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

⑤在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑦在任何情况下，基金管理人如采用本项第①－⑥小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第①－⑥小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑧国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4）权证估值方法：

①基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

②首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

③因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

④在任何情况下，基金管理人如采用本项第①－③项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第①－③项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑤国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5）其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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。

（3）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第③项、债券估值方法的第⑦项、权证估值方法的第④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。

3、基金份额净值错误的处理方式

（1）当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额

持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

2)若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

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

4)由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）基金所投资之目标 ETF 发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形；

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

（4）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；

（5）如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

（6）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金合同生效后，基金管理人和基金托管人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、记录和保管本基金的全套账册，定期与对方的账册进行核对，相互监督，以保证基金财产的安全。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

7、基金财务报表与定期报告的编制和复核

（1）财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 工作日内完成。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；半年度报告在会计年度上半年终了后 60 日内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并予以公告。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、半年度报告或者年度报告。

（2）报表复核

基金管理人在报表或定期报告完成当日，对报表盖章后，以加密传真方式或双方书面商定的其他方式将有关报表提供基金托管人复核。基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部业务专用章，或者出具加盖托管业务部业务专用章的复核意见书，相关各方各自留存一份。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 2 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，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中国证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的

基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

2、基金托管协议终止的情形

（1）基金合同终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十二、对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。本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）持有人交易资料的寄送服务

1、每次交易结束后，可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；

2、每季度结束后 15 个工作日内，本基金管理人向本季度有交易（账户类交易除外）的所有投资者寄送对账单；每年度结束后 15 个工作日内，本基金管理人向所有截至年底持有本基金份额或本年第四季度有交易（账户类交易除外）的所有投资者寄送对账单。本基金管理人提醒投资者如过期未收到对账单，或地址信息等发生变化时及时与本基金管理人客户服务中心（400-700-5000，021-61055000）联系。

（二）网上交易服务

本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以直接通过本基金管理人网站的 e 网行办理开户和本基金前端基金份额的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上交易后端基金份额的认/申购业务，通过转托管转入网上直销账户的后端收费模式的基金份额只能办理赎回业务。通过 e 网行办理本基金前端申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率的优惠，通过 e 网行办理本基金前端收费模式下转换入业务的个人投资者将享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠，其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的 e 网行直销申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

在条件成熟的时候，本基金管理人将根据基金网上交易业务的发展状况，适时扩大可用于基金网上交易平台或用于交易支付的银行卡种类，敬请投资者留意相关公告。

（三）信息咨询、查询服务

投资者如果想查询申购、赎回等交易情况、分红方式状态、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打本基金管理人客户服务电话（400-700-5000，021-61055000）或登录本基金管理人网站（www.jyfund.com，www.jysld.com，www.bocomschroder.com）进行咨询、查询。

本基金管理人为投资者预设基金查询密码，预设的基金查询密码为投资者开户证件号码的后 6 位数字，不足 6 位数字的，前面加“0”补足。基金查询密码用于投资者通过客户服务电话查询基金账户下的账户和交易信息。投资者请在其知晓基金账号后，及时拨打本基金管理人客户服务电话修改基金查询密码。

投资者可以拨打本基金管理人客户服务电话投诉直销机构的人员和服务。

（四）基金红利再投资

本基金收益分配时，投资者可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，再投资红利按红利再投日（即除息日）除息后的基金份额净值自动转为基金份额，并免收申购费用。

（五）定期定额投资计划

本基金已开通定期定额投资和转换业务，具体实施方法请参见相关公告。

服务联系方式：

基金管理人的互联网地址及电子信箱

网址：www.jyfund.com，www.jysld.com, www.bocomschroder.com

电子信箱：services@jysld.com

投资者也可登录本基金管理人网站，在“服务”的“我要提问”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

二十三、其他应披露事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

1、自合同生效以来，本基金管理人及基金托管人涉及托管业务无诉讼、仲裁事项。

2、本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

3、本基金最新定期报告请见 2012 年 10 月 26 日公告的《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年第 3 季度报告》。

4、本招募说明书更新期间基金披露的其他重要事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2011 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-30
2	交银施罗德基金管理有限公司关于中国工商银行延长其个人电子银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-30
3	交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-4-23
4	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司网上银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-4-27
5	交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金（更新）招募说明书摘要（2012 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-12
6	交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-18
7	交银施罗德基金管理有限公司关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-19
8	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与杭州数米基金销售有限公司基金申购及定期定额投资业务前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-27

9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加深圳众禄基金销售有限公司为旗下部分基金场外代销机构并参与网上交易系统费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-3
10	交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2012 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-28
11	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金场外代销机构并参与网上交易系统费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-31
12	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司网上银行基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-9-28

二十四、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人、基金托管人处，投资者可在办公时间查阅；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(www.jyfund.com，www.jysld.com 或 www.bocomschroder.com)查阅和下载招募说明书。

二十五、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会核准交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

（二）《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

（三）《交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金之法律意见书