



深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式 指数证券投资基金 更新的招募说明书

（二零一三年第一号）

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一三年二月

重要提示

深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证TMT50ETF”、“本基金”）经中国证券监督管理委员会2011年4月27日《关于核准深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可〔2011〕605号文）核准公开募集。本基金的基金合同于2011年6月27日正式生效。本基金为契约型开放式。

招商基金管理有限公司（以下称“本基金管理人”或“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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身风险承受能力，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。

本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，采用完全复制法紧密跟踪深证TMT50指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。投资本基金的风险包括：标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金退市风险、投资者申购/赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、TMT行业投资的特定风险、以及基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。本基金适合具有较高风险承受能力、并能正确认识和对待本基金可能出现的投资风险的投资者。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

投资有风险，过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

本更新招募说明书所载内容截止日为2012年12月27日，有关财务和业绩表现数据截止日为2012年9月30日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已于2013年1月23日复核了本次更新的招募说明书。



目 录

一、绪 言	2
二、释 义	2
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	15
五、相关服务机构.....	19
六、基金的募集与基金合同的生效.....	22
七、基金份额折算与变更登记.....	23
八、基金份额的交易.....	25
九、基金份额的申购与赎回.....	27
十、基金的投资.....	34
十一、基金的业绩.....	42
十二、基金的财产.....	42
十三、基金资产的估值.....	44
十四、基金的收益与分配.....	48
十五、基金的费用与税收.....	50
十六、基金的会计与审计.....	52
十七、基金的信息披露.....	53
十八、风险揭示.....	57
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	61
二十、基金合同的内容摘要.....	63
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	74
二十二、对基金份额持有人的服务.....	84
二十三、其他应披露事项.....	84
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	86
二十五、备查文件.....	86

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等相关法律法规和《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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本基金合同的当事人，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，除非另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金	依据基金合同所募集的深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金，简称深证 TMT50ETF
中国	中华人民共和国（仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
交易型开放式指数基金	《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，即指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易
ETF 联接基金	是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的的指数的 ETF（以下简称目标 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，采用开放式运作方式的基金。简称联接基金
基金合同	《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
招募说明书	《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	招商基金管理有限公司



基金托管人	中国银行股份有限公司
基金份额持有人	根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金合同当事人	受基金合同约束，根据基金合同享受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
个人投资者	符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
销售机构	基金管理人、发售代理机构及申购赎回代理券商
基金销售网点	基金销售机构的销售网点
发售代理机构	指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构
申购赎回代理券商	指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司
登记结算业务	指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务
注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司
认购	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为，投资者可以现金或股票方式申请认购
发售	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金合同生效后，基金投资者以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	基金合同生效后，基金投资者向基金管理人卖出基金份额以取得申购赎回清单所规定的赎回对价的行为
申购赎回清单	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
申购对价	指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
赎回对价	指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给投资者的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价



组合证券	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
标的指数	指深圳证券信息有限公司和深圳证券交易所编制并发布的深证电子信息传媒产业 50 指数（简称“深证 TMT50 指数”）及其未来可能发生的变更
完全复制法	一种跟踪指数的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组合，达到复制指数的目的
现金替代	指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
现金差额	指最小申购、赎回单位的资产净值与按 T 日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算
最小申购、赎回单位	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍
基金份额参考净值	指深圳证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV
预估现金部分	指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商（代办证券公司）预先冻结
基金份额折算	指本基金建仓结束后，基金管理人根据本基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为
基金账户	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金存续期	基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	深圳证券交易所的正常交易日
开放日	申购赎回代理券商办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日



T+n 日	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数
转托管	投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
收益分配基准日	期末可供分配利润计算截止日
基金可供分配利润	指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数
基金资产总值	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：招商基金管理有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 28 楼

成立日期：2002 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 2.1 亿元

法定代表人：马蔚华

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 28 楼

电话：(0755) 83196351

传真：(0755) 83076974

联系人：曾倩

股权结构和公司沿革：

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会证监基金字[2002]100 号文批准设立，是中国第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.（荷兰投资）、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建。经公司股东会通过以及中国证监会批准，公司的注册资本金已经由人民币一亿元（RMB 100,000,000 元）增加为人民币二亿一千万（RMB 210,000,000 元）。2007 年 5 月 22 日，经公司股东会通过并由中国证监会批复同意，招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司 10%、10%、10% 及 3.4% 的股权；公司外资股东 ING Asset Management B.V.（荷兰投资）受让招商证券股份有限公司持有的公司 3.3% 的股权。目前招商基金管理有限公司的股东股权结构为：招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 33.4%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 33.3%，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的 33.3%。

公司主要中方股东招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，总行设在深圳，业务以中国市场为主。招商银行于 2002 年 4 月 9 日在上海证券交易所上市（股票代码：600036）。2006 年 9 月 22 日，招商银行在香港联合交易所上市（股份代号：3968）。目前，招商银行注册资本为人民币 215.77 亿元，总资产超过人民币两万亿元。

招商证券股份有限公司是百年招商局旗下金融企业，经过多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009 年 11 月，招商证券在上海证券交易所上市（代码 600999）。

公司外方股东 ING Asset Management B.V.（荷兰投资）是 ING 集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。ING 集团是全球最大的多元化金融集团之一，投资业务遍及 60 多个国家。

公司本着“诚信、融合、创新、卓越”的经营理念，力争成为客户推崇、股东满意、员工热爱，并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

（二）目前所管理基金的基本情况

本基金管理公司目前管理二十八只共同基金，包括：招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票基金、招商安泰平衡型基金、招商安泰债券基金）、招商现金增值开放式证券投资基金、招商先锋混合型证券投资基金、招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）、招商安本增利债券型证券投资基金、招商核心价值混合型证券投资基金、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金、招商安心收益债券型证券投资基金、招商行业领先股票型证券投资基金、招商中小盘精选股票型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）、招商深证 100 指数证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）、招商安瑞进取债券型证券投资基金、深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商安达保本混合型证券投资基金、招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金、招商产业债券型证券投资基金、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金、招商信用增强债券型证券投资基金、招商安盈保本混合型证券投资基金、招商理财 7 天债券型证券投资基金。

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍：

马蔚华，男，西南财经大学经济学博士，美国南加州大学荣誉博士，高级经济师。1982 年至 1985 年，在辽宁省计委工作，历任副处长、副秘书长；1985 年至 1986 年，在辽宁省委办公厅工作；1986 年至 1988 年，在中共安徽省委办公厅工作；1988 年至 1990 年，任中国人民银行办公厅副主任；1990 年至 1992 年，任中国人民银行计划资金司副司长；1992 年至 1998 年，任中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长；1999 年 3 月至今任招商银行行长。现任本公司董事长。

Satish Bapat，男，美国费城天普大学工商管理硕士，注册会计师。1994 年，加入美国德勤会计师事务所；2010 年，加入 ING 投资管理任首席财务总监，现任首席执行官。现任本公司董事。

邓晓力，女，高级分析师。美国纽约州州立大学经济学博士。历任 AT&T 任市场科学决策部市场分析师，Providian Financial 金融公司高级风险分析师，花旗银行风险管理部高级分析师。2001 年 11 月加入招商证券，历任风险管理部副总经理、总经理，其间于 2004 年 1 月至 9 月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作。现任招商证券副总裁，分管财务部、风险控制部、清算中心、培训中心。现任本公司董事。

许小松，男，经济学博士。历任深圳证券交易所综合研究所副所长，南方基金管理有限公司首席经济学家、副总经理，国联安基金管理有限公司总经理，2011 年加入招商基金管理有限公司，

现任公司总经理、董事。

郑文光，男，美国寿险管理学会寿险管理院士、香港中文大学工商管理硕士。1973 年至 1984 年间先后担任美国友邦保险有限公司香港区副总裁助理、市场拓展部经理、副总裁（营业部）等职务；1984 年至 2000 年间先后担任安泰人寿保险（百慕达）有限公司助理总经理、总经理、执行董事等职务；2000 年至 2009 年间担任 ING 集团亚太区香港、澳门地区总经理。1988 年至今担任香港海港扶轮社社员；1999 年至今担任香港童军总会筲箕湾区会会长；2010 年至今担任交通康联人寿保险公司独立董事。现任本公司独立董事。

陈春花，女，华南理工大学工商管理学院教授、博导，南京大学博士后。曾任华南理工大学工商管理学院副院长，现任北京大学客座研究员、新加坡国立大学客座教授、澳洲国立大学国际管理硕士课程客座教授、广东省企业管理协会常务理事、广东省企业文化协会常务理事和广东省精神文明协会理事。陈春花教授曾先后出任山东六和集团总裁、康佳集团、科龙集团、TCL 集团、美的家电、南方航空、广东电信等公司管理顾问。讲授课程主要有《组织行为学》、《企业文化与跨文化管理》等。现任本公司独立董事。

周语菡，女，美国加州州立大学索诺玛分校 MBA。曾先后就职于丸红株氏会社（美国）公司产品部，Ananda(USA) 亚洲业务部，美国 ASI 太平洋地区业务发展部副主任，美国 iLink Global 公司高级分析员以及咨询委员会委员。2001 年初至 2005 年，就职于香港招商局中国投资管理有限公司，出任董事总经理一职，管理上市直接投资基金-招商中国直接投资基金（HK0133）。其间曾先后出任招商证券监事会主席，巨田证券监事会主席，巨田基金管理有限公司董事等职务。2006 年至 2007 年，任职于中集集团，出任南美战略发展项目负责人。2008 年至今，出任招商局中国基金有限公司（HK0133）之董事及招商局中国投资管理有限公司的董事总经理。现任公司独立董事。

张卫华，女，会计师。1981 年 07 月—1983 年 11 月，任江苏省连云港市汽车运输公司财务部会计；1983 年 11 月—1988 年 08 月，任中国银行连云港分行外汇会计部主任；1988 年 08 月—1994 年 11 月，历任招商银行总行国际部、会计部主任、证券业务部总经理助理；1994 年 11 月—2006 年 02 月，历任招银证券、国通证券及招商证券股份有限公司总裁助理兼稽核审计部总经理；2001 年 12 月—2009 年 04 月，任招商证券股份有限公司职工代表监事；2006 年 03 月—2009 年 04 月，任招商证券股份有限公司稽核监察总审计师；2009 年 04 月起任招商证券股份有限公司合规总监，现任公司监事会主席。

周松，男，武汉大学世界经济本科专业，硕士学历。1997 年 2 月加入招商银行，1997 年 2 月至 2006 年 6 月历任招商银行总行计划资金部经理、总经理助理、副总经理，2006 年 6 月至 2007 年 7 月任招商银行总行计划财务部副总经理，2007 年 7 月至 2008 年 11 月任招商银行武汉分行副行长。2008 年 11 月至 2010 年 6 月担任招商银行总行计划财务部副总经理（主持工作）。2010 年 6 月起任招商银行总行计划财务部总经理，现任公司监事。

钟丽仪，女，香港中文大学行政人员工商管理硕士学位、美国加州州立大学弗雷斯诺分校科学学士学位。自 1991 年以来一直在资产管理行业工作，曾先后任职富达投资香港高级经理、巴克莱国

际基金亚洲区销售副总监、巴克莱国际投资管理（BGI）大中华区机构业务发展总监，2010年5月加入ING投资管理公司，任北亚区机构业务发展主管，负责ING投资管理北亚地区的机构业务发展。现任公司监事。

路明，男，中南财经政法大学金融学硕士。1999年加入银华基金管理公司，担任交易主管职务；2005年加入东方基金管理公司，担任交易总监职务；2006年7月加入招商基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员、首席交易员，现任交易部总监，公司监事。

庄永宙，男，清华大学工学硕士。1996年加入中国人民银行深圳市中心支行科技处；1997年加入招商银行总行电脑部；2002年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后曾任信息技术部高级经理、副总监，现任信息技术部总监，公司监事。

王晓东，女，上海财经大学经济学硕士。曾任南方证券有限公司深南中路营业部总经理、深圳特区证券总经理助理、巨田基金管理有限公司（现摩根士丹利华鑫基金）副总经理、华林证券有限责任公司总裁，2007年加入招商证券股份有限公司。2007年9月至2010年3月任招商基金管理有限公司监事长，现任招商基金管理有限公司副总经理。

赵生章，男，中国人民大学经济学博士。曾任国信证券有限公司投资银行部任项目经理、招商证券股份有限公司投资银行二部副经理、内核部经理（投行内核小组负责人）、公司董事会办公室主任（负责公司公开发行及上市等相关事宜），2002年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后曾任督察长、总经理助理，现任招商基金管理有限公司副总经理。

欧志明，男，华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士；2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理；2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作；2004年7月加入招商基金管理有限公司，曾任法律合规部高级经理、副总监、总监，现任公司督察长兼董事会秘书。

2、本基金基金经理介绍

王平，男，中南大学管理科学与工程专业硕士。2006年加入招商基金管理有限公司，历任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理、副总监，主要从事投资风险管理、金融工程与数量化投资策略研究、股指期货投资策略研究等工作。现任招商深证100指数证券投资基金基金经理（管理时间：2010年6月22日至今）、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理（管理时间：2010年12月8日至今）、深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理（管理时间：2011年6月27日至今）、招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2012年6月28日至今）。

3、投资决策委员会成员：

公司的投资决策委员会由如下成员组成：总经理助理兼固定收益投资部负责人张国强、总经理助理兼股票投资部负责人袁野、总经理助理兼量化投资部负责人吴武泽、总经理助理兼专户资产投资部负责人杨渺、基金经理陈玉辉、交易部总监路明。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（四）基金管理人职责

根据《基金法》，基金管理人必须履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回及转换价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（五）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺不得从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》等法律法规及规章的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、基金管理人禁止利用基金财产从事以下投资或活动：

- （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，但国务院另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者

债券；

- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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；
- (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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、本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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金
投资计划等信息；
- (8) 除为公司进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、本基金管理人承诺履行诚信义务，如实披露法规要求的披露内容。

6、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、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基
金投资计划等信息；
- (4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(六) 内部控制制度

1、内部控制的原则

健全性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、成本效益原则。

2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管

理层和操作层的全面监督和控制。具体而言，包括如下组成部分：

- (1) 监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。
- (2) 董事会风险控制委员会：风险控制委员会作为董事会下设的专门委员会之一，负责决定公司各项重要的内部控制制度并检查其合法性、合理性和有效性，负责决定公司风险管理战略和政策并检查其执行情况，审查公司关联交易和检查公司的内部审计和业务稽查情况等。
- (3) 督察长：督察长负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并负责组织指导公司监察稽核工作。督察长发现基金和公司存在重大风险或隐患，或发生督察长依法认为需要报告的其他情形以及中国证监会规定的其他情形时，应当及时向公司董事会和中国证监会报告。
- (4) 风险管理委员会：风险管理委员会是总经理办公会下设的负责风险管理的专业委员会，主要负责对公司经营管理中的重大问题和重大事项进行风险评估并作出决策，并针对公司经营管理活动中发生的重大突发性事件和重大危机情况，实施危机处理机制。
- (5) 监察稽核部门：监察稽核部门负责对公司内部控制制度和风险管理政策的执行情况进行合规性监督检查，向公司风险管理委员会和总经理报告。
- (6) 各业务部门：风险控制是每一个业务部门和员工最首要的责任。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

3、内部控制制度概述

(1) 内控制度概述

公司内控制度由内部控制大纲、公司基本制度、部门管理办法和业务管理办法组成。

其中，公司内控大纲包括《内部控制大纲》和《法规遵循政策（风险管理制度）》，它们是各项基本管理制度的纲要和总揽，是对公司章程规定的内控原则的细化和展开。

公司基本制度包括投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、监察稽核制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度、人力资源管理制度和危机处理制度等。部门管理办法在公司基本制度基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任进行了规范。业务管理办法对公司各项业务的操作进行了规范。

(2) 风险控制制度

内部风险控制制度由一系列的具体制度构成，具体包括内部控制大纲、法规遵循政策、岗位分离制度、业务隔离制度、标准化作业流程制度、集中交易制度、权限管理制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

(3) 监察稽核制度

公司设立相对独立的内部控制组织体系和监察稽核部门。监察稽核部门的职责是依据国家的有

关法律法规、公司内部控制制度在所赋予的权限内按照所规定的程序和适当的方法对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价，包括调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性、检查公司执行国家法律法规和公司规章制度的情况、进行日常风险控制的监控工作、执行公司内部定期不定期的内部审计、调查公司内部的违法案件等。

4、 内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

(1) 控制环境

公司致力于树立内控优先和风险控制的理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的风险控制的文化氛围和环境，使全体员工及时了解相关的法律法规、管理层的经营思想、公司的规章制度并自觉遵循，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。

(2) 风险评估

公司对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析，发现风险，并将风险进行分类，找出风险分布点，并对风险进行分析和评估，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。落实责任人，并不断完善相关的风险防范措施。

(3) 控制活动

公司控制活动主要包括组织结构控制、操作控制和会计控制等。

A. 组织结构控制

各部门的设置体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销部等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成了权责分明、严密有效的三道监控防线：

a. 以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，并有相应的岗位说明书和岗位责任制，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险。

b. 各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道监控防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部部门及岗位负有监督和检查的责任。

c. 以督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

B. 操作控制

公司设定了一系列的操作控制的制度手段，如标准化业务流程、业务、岗位和空间隔离制度、授权分责制度、集中交易制度、保密制度、信息披露制度、档案资料保全制度、客户投诉处理制度等，控制日常运作和经营中的风险。

C. 会计控制

公司确保基金资产与公司自有财产完全分开，分帐管理，独立核算；公司会计核算与基金会计

核算在业务规范、人员岗位和办公区域上进行严格区分。公司对所管理的不同基金以及本基金下分别设立账户，分帐管理，以确保每只基金和基金资产的完整和独立。

(4) 信息沟通

即指及时地实现信息的流动，如自下而上的报告和自上而下的反馈。

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

公司制定管理和业务报告制度，包括定期报告制度和不定期报告制度。定期报告制度按照每日、每月、每年度等不同的时间频次进行报告。

- a. 执行体系报告路线：各业务人员向部门负责人报告；部门负责人向分管领导、总经理报告；
- b. 监督体系报告路线：公司员工、各部门负责人向监察稽核部门报告，监察稽核部门向总经理、督察长分别报告；
- c. 督察长定期出具监察报告，报送董事会及其下设的风险控制委员会和中国证监会；如发现重大违规行为，应立即向董事会和中国证监会报告。

(5) 内部监控

督察长和监察稽核部门人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度有效地实施。公司监事会、董事会风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门对内部控制制度持续地进行检验，检验其是否符合规定要求并加以充实和改善，及时反映政策法规、市场环境、技术等因素的变化趋势，保证内控制度的有效性。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

发展概况：

1912 年 2 月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从 1912 年至 1949 年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994 年，中国银行改为国有独资商业银行。2003 年，中国银行启动股份制改造。2004 年 8 月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及 31 个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，

被 Finance Asia (《金融亚洲》) 评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行, 被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇, 中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展, 向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部, 为进一步树立以投资者为中心的服务理念, 中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部, 现有员工 120 余人。另外, 中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前, 中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内, 中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务, 为各类客户提供个性化的托管服务。2011 年末, 中国银行各类托管资产规模突破两万亿元, 居同业前列。

(三) 证券投资基金托管情况

截至 2012 年 6 月末, 中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合 (LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、

民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普 500 等权重指数（QDII）、长信标普 100 等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、

业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

(一) 场内申购、赎回代理机构

(1) 代销机构：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82960223

传真：(0755) 82960141

联系人：林生迎

(2) 代销机构：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：余江

(3) 代销机构：国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人：张雅锋

电话：(0755)83709350

传真：(0755)83704850

联系人：牛孟宇

(4) 代销机构：广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：刘东

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

(5) 代销机构：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100



联系人：金芸、李笑鸣

(6) 代销机构：华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122222

传真：(021) 50122200

联系人：宋歌

(7) 代销机构：东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

(8) 代销机构：东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：徐勇力

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

(9) 代销机构：山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

(10) 代销机构：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568532

联系人：田薇

(11) 代销机构：宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

法定代表人：冯戎



电话：(010) 88085858

传真：(010) 88085195

联系人：李巍

(12) 代销机构：红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

电话：0871-3577398

传真：0871-3578827

联系人：高国泽

(13) 代销机构：申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：曹晔

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：严峰

电话：(0755) 25946013

传真：(0755) 25987122

(三) 律师事务所和经办律师

名称：北京市高朋律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 28 层

法定代表人：王磊

电话：(010) 59241188

传真：(010) 59241199

经办律师：王明涛、李勃

联系人：王明涛

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所有限公司
注册地址：上海市延安东路 222 号 30 楼
法定代表人：卢伯卿
电话：(021) 61418888
传真：(021) 63350177
经办注册会计师：曾浩、汪芳
联系人：曾浩

六、基金的募集与基金合同的生效

（一）基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》、《业务规则》等有关法律、法规、规章及基金合同，并经中国证券监督管理委员会 2011 年 4 月 27 日证监许可〔2011〕605 号文核准公开募集。募集期从 2011 年 5 月 16 日起到 6 月 21 日止，共募集 347,195,545.00 份基金份额，有效认购总户数为 3,075 户。

（二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2011 年 6 月 27 日正式生效。

七、基金份额折算与变更登记

（一）基金份额折算的时间

基金合同生效后,基金管理人应逐步调整实际组合直至达到跟踪标的指数要求,此过程为基金建仓。基金建仓期不超过 3 个月。

基金建仓期结束后,基金管理人确定基金份额折算日,并提前公告。

（二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人办理,并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算目标的指数收盘值的千分之一基本一致。

基金份额折算后,本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后,基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力,基金管理人可延迟办理基金份额折算。

（三）基金份额折算的方法

1、基金份额折算程序与计算公式

(1) 基金管理人确定基金份额折算日(T日),并提前公告。

(2) T日收市后,基金管理人计算当日的基金资产净值 X、基金份额总额 Y,并与基金托管人进行核对。

(3) 假设 T 日的指数收盘值为 I,则 T 日的目标基金份额净值为 $I/1000$,基金份额折算比例的计算公式为:

折算比例 = $(X/Y) / (I/1000)$,以四舍五入的方法保留小数点后 8 位。

(4) 基金管理人根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算,折算后的基金份额保留到整数位(小数点后面的部分舍去,舍去部分计入基金财产),加总得到折算后的基金份额总额。基金管理人将折算后的各基金份额持有人持有的基金份额数据发送给注册登记机构,并将折算后的基金份额总额数据发送给基金托管人。

(5) 注册登记机构根据基金管理人提供的数据为基金份额持有人进行基金份额的变更登记。

(6) 基金管理人、基金托管人根据折算后的基金份额总额,进行相应的会计处理,计算 T 日折算

后的基金份额净值,并互相核对。

(7) 在注册登记机构完成份额折算和变更登记次日,基金管理人公告基金份额折算结果。注册登记机构完成份额折算和变更登记后 3 个工作日内,投资者可以在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额

2、基金份额折算的举例

假设某投资者在基金募集期内认购了 1,000 份深证 TMT50ETF,基金份额折算日的基金资产净值为 3,127,000,230.95 元,折算前的基金份额总额为 3,013,057,000 份,当日标的指数收盘值为 2481.82。

$$(1) \text{ 折算比例} = (3,127,000,230.95 / 3,013,057,000) / (2481.82 / 1000) = 0.41816751$$

$$(2) \text{ 该投资者折算后的基金份额} = 1,000 \times 0.41816751 = 418$$

八、基金份额的交易

（一）基金份额上市

基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券交易所申请基金份额上市:

- 1、基金募集金额(含募集股票市值)不低于 2 亿元;
- 2、基金份额持有人不少于 1,000 人;
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的,基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定,包括但不限于:

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一工作日基金份额净值;
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%,自上市首日起实行;
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍,不足 100 份的部分可以卖出;
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元;
- 5、本基金可适用大宗交易的相关规则。

（三）终止上市交易

基金份额上市交易后,有下列情形之一的,深圳证券交易所可终止基金份额的上市交易,并报中国证监会备案:

- 1、不再具备本部分第一款规定的上市条件;
- 2、基金合同终止;
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市;
- 4、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

深圳证券交易所应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

若因上述 1、3、4 项原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接以深证 TMT50 指数为标的的非上市的开放式指数基金。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

（四） 基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向深圳证券交易所提供当日的申购、赎回清单，深圳证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值 = (申购、赎回清单中必须用现金替代的替代金额 + 申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和 + 申购、赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 3 位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所

基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可根据情况变更或增减申购赎回代理券商的名单。

（二）申购、赎回的开放日期及办理时间

1、申购与赎回的开始时间

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购。在基金申请上市期间，本基金可暂停办理申购。

本基金自基金合同生效后最迟不超过 3 个月开始办理申购、赎回。

具体申购、赎回的开始时间由基金管理人确定后，于申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。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。

若深圳证券交易所交易时间更改或依据实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日及具体业务办理时间进行相应调整并公告。

（三）申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定；
- 5、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回

的申请。

投资者在申购本基金时须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

2、申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在T+1日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果注册登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（五）申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为25万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购与赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价、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。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资者的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

（七）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

(1) 现金替代的类型

现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

(2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额 = 替代证券数量 × 该证券经除权调整的T-1日收盘价 × (1 + 现金替代溢价比例)

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，

则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给注册登记机构，注册登记机构办理现金替代多退少补资金的清算；T+2日后第2个工作日（若在特例情况下，则为T日起第22个交易日），注册登记机构办理现金替代多退少补资金的交收。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{只替代证券数量} \times \text{该证券经除权调整的}T-1\text{日收盘价}}{\text{申购基金份额} \times T-1\text{日基金份额净值}}$$

（3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券，或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的T-1日收盘价。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购、赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

T日预估现金差额 = T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和)

其中，T日经除权调整前的收盘价由深圳证券交易所提供。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额 = T日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和)

T日投资者申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。



现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

2012年12月27日申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	2012-12-27
基金名称	深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司	招商基金管理有限公司
基金代码	159909
标的指数代码	399610
2012-12-26 信息内容	
现金差额(单位：元)	-6014.49
最小申购、赎回单位资产净值(单位：元)	591636.51
基金份额净值(单位：元)	2.367
2012-06-27 信息内容	
预估现金部分（单位：元）	-6512.49
最小申购、赎回单位(单位：份)	250000
最小申购、赎回单位分红金额（单位：元）	0
是否需要公布 IOPV	是
是否允许申购	是
是否允许赎回	是
可以现金替代比例上限	40.0%

成分股信息资料					
证券代码	证券简称	证券数量	现金替代标志	可以现金替代保证金率	固定替代金额
000021	长城开发	1500	允许	15.0%	
000049	德赛电池	200	允许	15.0%	
000050	深天马 A	700	允许	15.0%	
000063	中兴通讯	2600	允许	15.0%	
000100	TCL 集团	18300	允许	15.0%	
000503	海虹控股	1800	允许	15.0%	



000527	美的电器	3400	允许	15.0%	
000532	力合股份		必须	0.0%	5383
000541	佛山照明	1300	允许	15.0%	
000636	风华高科	1400	允许	15.0%	
000651	格力电器	1800	允许	15.0%	
000727	华东科技		必须	0.0%	3017
000793	华闻传媒	2200	允许	15.0%	
000823	超声电子	700	允许	15.0%	
000839	中信国安	2400	允许	15.0%	
000851	高鸿股份		必须	0.0%	5056
000901	航天科技	400	允许	15.0%	
000917	电广传媒	1900	允许	15.0%	
000970	中科三环	900	允许	15.0%	
000977	浪潮信息	300	允许	15.0%	
000988	华工科技	1500	允许	15.0%	
000997	新大陆	900	允许	15.0%	
002005	德豪润达	1300	允许	15.0%	
002008	大族激光	1900	允许	15.0%	
002017	东信和平		必须	0.0%	2901
002025	航天电器	500	允许	15.0%	
002056	横店东磁	500	允许	15.0%	
002063	远光软件	600	允许	15.0%	
002065	东华软件	700	允许	15.0%	
002079	苏州固锟	800	允许	15.0%	
002093	国脉科技	900	允许	15.0%	
002104	恒宝股份	800	允许	15.0%	
002106	莱宝高科	1000	允许	15.0%	
002129	中环股份	800	允许	15.0%	
002152	广电运通	800	允许	15.0%	
002156	通富微电		必须	0.0%	2751
002161	远望谷	1200	允许	15.0%	
002218	拓日新能	500	允许	15.0%	
002230	科大讯飞	700	允许	15.0%	

002236	大华股份	600	允许	15.0%	
002241	歌尔声学	700	允许	15.0%	
002242	九阳股份	700	允许	15.0%	
002261	拓维信息	400	允许	15.0%	
002292	奥飞动漫	300	允许	15.0%	
002405	四维图新	900	允许	15.0%	
002415	海康威视	1100	允许	15.0%	
002506	超日太阳	1100	允许	15.0%	
300002	神州泰岳		必须	0.0%	4629
300027	华谊兄弟	900	允许	15.0%	
300077	国民技术	400	允许	15.0%	

（八）暂停申购、赎回的情形

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的申购、赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购、赎回申请；
- 2、因深圳证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金财产净值；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单；
- 5、深圳证券交易所、注册登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回；
- 6、法律法规、中国证监会或深圳证券交易所规定的其他情形。

在发生上述暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》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。

（九）基金的非交易过户等其他业务

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

十、基金的投资

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资理念

随着现代信息技术的不断发展成熟，中国的 TMT 产业将进入快速发展阶段，本基金通过完全复制的被动式投资，力争使基金与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，为投资者提供标的指数所代表市场的平均收益水平。

（三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括深证 TMT50 指数的成份股及其备选成份股、一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于深证 TMT50 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。

（四）投资策略

本基金以深证 TMT50 指数为标的指数，采用完全复制法，即完全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。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，但在特殊情况下，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票进行适当替代，这些情况包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其他原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（五）投资组合管理

1、投资组合的构建

（1）确定目标组合。主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基

金股票投资组合。

(2) 制定建仓策略。依据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素所做的分析，制定合理的建仓策略。

(3) 逐步调整组合。基金经理在规定时间内，采取适当的手段和措施，对实际投资组合进行动态调整，直至达到紧密跟踪标的指数的目标。

2、日常投资组合管理

(1) 标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(2) 标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

(3) 成份股公司行为信息的日常跟踪与分析

跟踪分析标的指数成份股公司行为等信息，如股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等重大公司信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

(4) 每日申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪分析每日基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

(5) 投资组合持有证券、现金头寸及流动性分析

跟踪分析每日基金实际投资组合与目标组合的差异及差异产生的原因，并对拟调整的成份股的流动性进行分析。

(6) 投资组合调整

使用量化分析模型，选择最优调整方案，制定组合交易调整策略；如标的指数成份股调整、成份股公司发生兼并等重大事件，可提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略；调整投资组合，达到所追求的目标组合的持仓结构。

(7) 制作管理基金每日申购赎回清单

以T-1日标的指数成份股的构成及其权重为基础，并考虑T日将发生的上市公司变动等情况，制作T日基金申购赎回清单并公告。

(8) 跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及原因，并优化跟踪偏离度管理方案。在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪

误差进一步扩大。

（六）投资决策流程

1、投资决策依据

- （1）须符合国家有关法律法规，严格遵守基金合同及公司章程；
- （2）维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

2、投资决策流程

（1）投资决策。投资决策委员会定期不定期召开投资决策委员会会议，对相关重大事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

（2）组合构建。基金经理采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

（3）交易执行。交易部负责基金的具体交易执行，同时履行一线监控的职责。

（4）组合监控与调整。基金经理在指数编制方法发生变更、指数成份股定期或临时调整、指数成份股出现股本变化、增发、配股等情形、成份股停牌、成份股流动性不足、基金申购赎回出现的现金流量等情形下，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

（5）绩效评估。基金经理及风险管理部定期不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估。风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员。基金经理依据绩效评估报告对投资进行总结或检讨，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

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

（七）投资限制

1、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，但国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （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；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股,基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下,将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1) 本基金投资于深证 TMT50 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%;

(2) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,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%,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%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

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

(4) 本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(5) 本基金不得违反基金合同关于其他投资比例的约定;

(6) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

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规定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(八) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证 TMT50 指数。

如果指数编制单位变更或停止深证 TMT50 指数的编制、发布或授权,或深证 TMT50 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致深证 TMT50 指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,或目标 ETF 标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限

于指数编制单位变更、指数更名等事项)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

（九）风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，采用完全复制法紧密跟踪深证 TMT50 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、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；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、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。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（十一）基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

（十二）基金投资组合报告

深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金管理人—招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至 2012 年 09 月 30 日，来源于《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金 2012 年第 3 季度报告》。

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	307,586,447.89	98.97
	其中：股票	307,586,447.89	98.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,687,836.20	0.86
6	其他资产	508,554.03	0.16
7	合计	310,782,838.12	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	197,445,816.15	63.76
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,620,177.16	0.85
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	128,018,993.62	41.34
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	65,233,756.37	21.07
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	1,572,889.00	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	66,724,495.38	21.55
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	25,941,920.76	8.38
M	综合类	17,474,215.60	5.64
	合计	307,586,447.89	99.33

2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	903,815	19,323,564.70	6.24
2	000100	TCL 集团	9,466,200	17,985,780.00	5.81
3	000527	美的电器	1,736,481	15,940,895.58	5.15
4	000063	中兴通讯	1,400,017	15,624,189.72	5.05
5	002415	海康威视	553,738	15,349,617.36	4.96
6	000970	中科三环	490,500	15,308,505.00	4.94
7	002241	歌尔声学	346,721	12,929,226.09	4.18



8	002236	大华股份	303,548	12,445,468.00	4.02
9	000917	电广传媒	971,917	11,565,812.30	3.74
10	002230	科大讯飞	363,650	10,334,933.00	3.34

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 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

本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8 投资组合报告附注

8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	8,069.74
3	应收股利	-
4	应收利息	484.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	508,554.03

8.4 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。



8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000527	美的电器	15,940,895.58	5.15	重大事项
2	000917	电广传媒	11,565,812.30	3.74	重大事项

8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

十一、基金的业绩

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

本报告期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
2011.06.27-2011.12.31	-28.25%	1.54%	-26.13%	1.64%	-2.12%	-0.10%
2012.01.01-2012.06.30	6.64%	1.60%	6.50%	1.61%	0.14%	-0.01%
2012.01.01-2012.09.30	2.10%	1.54%	1.67%	1.55%	0.43%	-0.01%
自基金合同生效日起至 2012.09.30	-26.75%	1.54%	-24.90%	1.59%	-1.85%	-0.05%

本基金合同生效日为 2011 年 6 月 27 日

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规及规范性文件开立基金的资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户相互独立。

（四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；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。

3、基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同、托管协议的规定处分外，基金财产不得被处分。

4、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范围。

5、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；基金管理人管理运作不同基金的基金财产的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，以双方认可的方式发送给基金管理人；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。

（五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

（2）交易所上市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、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市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、证券发行机

构未发生影响证券价格的重大事件的，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进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

4、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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对于基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额

净值估值错误。

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财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

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、或代理销售机构、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，过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无法预见、无法避免、无法抗拒，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（“受损方”），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，如果因基金管理人过错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，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，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、行政法规、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出现过错的当事人进行追索，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的交易数据的，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。

(七) 暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

(八) 特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；
- 2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施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

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 3、当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上时，可进行收益分配；
- 4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 5、本基金收益分配方式为现金分红；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率和标的指数同期累计报酬率，并计算基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率的差额，当差额超过 1%时，基金管理人可进行收益分配。

其中：收益评价日指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率差额之日；

基金累计报酬率=收益评价日基金份额净值/基金份额折算日基金份额净值-100%；

标的指数同期累计报酬率=收益评价日标的指数收盘值/基金份额折算日标的指数收盘值-100%。

2、计算截至收益分配基准日本基金的可供分配利润，并根据前述原则确定收益分配比例及收

益分配数额。

（五）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（六）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在权益登记日前 2 日于指定媒体及基金管理人网站上公告。

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

（七）基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

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、标的指数许可使用费；
 - 4、基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用；
 - 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
 - 6、基金上市费及年费；
 - 7、基金收益分配中发生的费用；
 - 8、基金份额持有人大会费用；
 - 9、基金的证券交易费用；
 - 10、基金的银行汇划费用；
 - 11、按照国家有关法律法规规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述一、基金费用的种类中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出

金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度执行国家有关会计制度。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案；
- 3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

十七、基金的信息披露

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至少一种指定媒体和基金管理人互联网网站等媒介披露，并保证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。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

基金合同生效后，基金管理人应当在每 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上。基金管理人应当在公告的 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。

（二）基金份额发售公告

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

（三）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媒体和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金财产净值、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财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之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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财产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金财产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（五）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应至少提前 2 日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网

站上。

基金份额进行折算并由注册登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

（六）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 日在指定报刊和网站上公告。

（七）申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站、申购赎回代理机构以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

（八）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（九）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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及更新的招募说明书。

1、基金年度报告：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上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：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上。

3、基金季度报告：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。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（十）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两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事件，包括：



- 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罚，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、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、变更标的指数；
- 27、基金份额持有人大会的决议；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

（十一）公开澄清

在基金合同期限内，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。

（十二）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

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。

本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，采用完全复制法紧密跟踪深证TMT50指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。投资本基金的风险包括：标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金退市风险、投资者申购/赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险以及基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，等等。本基金适合具有较高风险承受能力、并能正确认识和对待本基金可能出现的投资风险的投资人。

基金管理人建议基金投资者在选择本基金之前，通过正规的途径，如：招商基金客户服务热线（4008879555），招商基金公司网站（www.cmfchina.com）或者通过其他代销机构，对本基金进行充分、详细的了解。在对自己的资金状况、投资期限、收益预期和风险承受能力做出客观合理的评估后，再做出是否投资的决定。投资者应确保在投资本基金后，即使出现短期的亏损也不会给自己的正常生活带来很大的影响。

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。

基金管理人提请投资者特别注意，因基金份额拆分、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。因基金份额拆分、

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，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份额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，由投资者自行承担。

投资于本基金的主要风险有：

1、市场风险：

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

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

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

(3) 利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 再投资风险：市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

(5) TMT 行业投资的风险：本基金的主要投资方向是与电子信息相关的新兴技术产业，该产业受国家政策影响较大，国家产业政策的变化可能导致行业投资环境发生变化。同时，TMT 行业中的中小型上市公司相对较多，与一些传统行业的大型上市公司相比，其流动性可能相对较弱，波动性可能相对较大一些。

2、ETF 特有的风险：

(1) 标的指数回报与行业平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个行业的市场表现。标的指数的回报率与整个行业的市场平均回报率可能存在偏离。

(2) 标的指数波动的风险

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

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2) 由于标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益

率，从而产生跟踪偏离度。

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(4) 标的指数变更的风险

如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，由此带来风险与成本。

(5) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

(6) 套利风险：由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和ETF 存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

(7) 参考净值（IOPV）决策和计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失。

(8) 申购赎回清单差错风险

基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，使投资者利益受损或影响申购赎回的正常进行。

(9) 退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

(10) 投资者申购失败的风险

本基金的申购、赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

(11) 投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失

败的情形。此外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

(12) 基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

3、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

(2) 登记结算机构注册登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、登记结算机构注册登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

4、管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

5、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构注册登记机构及销售代理机构等。

6、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记结算机构注册登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动、深圳证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算小组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算小组

（1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

二十、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人的权利、义务

1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （5）在基金合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行基金合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （6）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （7）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查，并从注册登记机构获取基金份额持有人名册；
- （8）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （9）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- （10）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- （11）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- （12）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- （13）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）在符合有关法律法规、交易所及注册登记机构相关业务规则和基金合同的前提下，制订和调整本基金业务规则；
- （16）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （17）法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 依法申请并募集基金，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分别管理、分别记账，进行证券投资；

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

(7) 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；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价清单；

(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以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之对价；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

(17) 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；

(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的合法权益，应承担赔偿责任，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) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

- (1) 自基金合同生效之日起，依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

- (1) 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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 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以保密，不得向他人泄露；
- (10) 根据法律法规及基金合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核基金管理人计算的基金资产净值；
- (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；
- (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) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人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，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 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；
- (5) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (6) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (7) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (8) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (9) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。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、鉴于本基金和本基金的联接基金（即“招商深证电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会

的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

3、有以下情形之一时，应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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (8) 本基金与其他基金合并；
- (9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利、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；
- (13) 法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

4、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费率、基金托管费率；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (5) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (7) 基金管理人、相关证券交易所和注册登记机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
- (8) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

5、召集方式：

- (1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金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或在规定时间内未能作出书面答复，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或在规定时间内未能作出书面答复，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%的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的或在规定时间内未能作出书面答复，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

(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。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

6、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前40天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名、电话；
- (5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

7、开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的表决意见以书面形式或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证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书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；

(4) 直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的其他代表，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书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果出现任何不符合上述基金份额持有人大会召开条件的情况，则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为40天，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应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件，才能视为有效。

8、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

a、议事内容限为本条前述第3款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

b、基金管理人、基金托管人、代表基金份额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至少35天前提交召集人。

c、对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(i) 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解释和说明。

(ii) 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做出决定。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做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

d、代表基金份额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，或基金

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，未获得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。

e、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。

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

a、现场开会

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

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、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。

b、通讯开会

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

9、表决

(1) 基金份额持有人所持每份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：

a、特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

b、一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）通过。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

9、计票

(1) 现场开会

a、基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

c、如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会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，大会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。

d、在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

e、计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。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。

10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，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。

(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、基金托管人均有法律约束力。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当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

(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。

- 11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金合同的变更和终止

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（3）但如因相应的法律法规发生变动、深圳证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- （3）基金合同约定的其他情形；
- （4）法律法规和中国证监会规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（四）争议的处理和适用的法律

- 1、基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

- 3、除争议所涉内容之外，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

（五）基金合同的存放和获得方式

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。



基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

二十一、基金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：招商基金管理有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

法定代表人：马蔚华

成立时间：2002年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]100号

注册资本：2.1亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：（0755）83196351

传真：（0755）83076974

联系人：曾倩

2、基金托管人

名称：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

法定代表人：肖钢

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。



存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括深证TMT50指数的成份股及其备选成份股、一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

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

基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及基金合同的约定，本基金的投资资产配置比例为：基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

（2）根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金投资于深证TMT50指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；

b、本基金在任何交易日买入权证的总金额，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%，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%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

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



d、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

e、本基金不得违反《基金合同》关于其他投资比例的约定；

f、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

(3) 法规允许的基金投资比例调整期限

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规定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

(4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

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、对基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或提供担保；

(3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

(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；

(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股

关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；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，若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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

4、基金管理人向基金托管人及时提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，对交易对手库予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及基金合同约定的基金投资的其他方面进行监督。

B、基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、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复核。

C、基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、基金合同及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

D、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、基金合同及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反基金合同、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

E、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（三）基金管理人

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于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、无正当理由未执行或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法律法规、基金合同及本协议有关规定时，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对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

（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。未经基金管理人的正当指令，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）除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

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，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名方式开立的证券账户下，基金托管人在收到资金和股票当日出具确认文件。同时，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

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、股票解冻事宜，基金托管人应提供充分协助。

3、基金的银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。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，均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。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) 基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立资金结算账户，用于办理本基金因申购、赎回产生的现金差额和现金替代多退少补资金的结算。

(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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

6、投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据注册登记机构的交收指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代的结算。根据基金管理人的指令办理现金差额的结算。

7、债券托管账户的开立和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户及向中国人民银行报备，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

8、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

9、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

(五) 基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(2) 基金管理人应每交易日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个交易日结束后计算当日的该基金份额资产净值，并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

(3) 当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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) 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

(5) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

(6) 除基金合同和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，

则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

2、基金会计核算

(1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

(2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应每月就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

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3个工作日内进行复核，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10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15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

盖托管业务部门公章的复核意见书，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证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

（七）适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

（八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。



2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- (1) 基金合同终止；
- (2) 本基金更换基金托管人；
- (3) 本基金更换基金管理人；
- (4) 发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照基金合同及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十二、对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺向基金份额持有人提供下列服务。同时，基金管理人有权根据投资者的需要和市场的变化，对以下服务内容进行相应调整。

（一）网络在线服务

基金份额持有人通过招商基金网站，可享受资讯查询、在线咨询、热点问题查询、理财论坛交流等服务，并可提交投诉与建议。

招商基金网址：www.cmfchina.com

招商基金理财社区 BBS 论坛：bbs.cmfchina.com

招商基金电子邮箱：cmf@cmfchina.com

（二）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心提供全天候24小时的自动语音查询服务，基金份额持有人可进行基金份额净值等信息的查询。

呼叫中心坐席提供每周六天（法定节假日除外），每天不少于7小时的人工热线咨询服务。基金份额持有人可通过该热线享受业务咨询、信息查询、投诉建议等专项服务。

招商基金全国统一客户服务热线：400-887-9555（免长途费）

（三）客户投诉受理服务

基金份额持有人可以通过直销和代销机构网点柜台的意见簿、基金公司网站、自动语音留言、呼叫中心人工热线、书信及电子邮件六种不同的渠道对基金公司和销售网点提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复，对于不能及时回复的投诉，基金公司承诺在24小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，将在顺延的工作日当日进行回复。

二十三、其他应披露事项

- 1、招商基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告 2012-12-5
- 2、关于深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金新增申银万国证券为申购赎回代办证券公司的公告 2012-12-5



- 3、招商基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告 2012-12-4
- 4、招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 2012-11-1
- 5、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金 2012 年第 3 季度报告 2012-10-24
- 6、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金 2012 年半年度报告摘要 2012-8-24
- 7、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金 2012 年半年度报告 2012-8-24
- 8、招商深证 TMT50ETF 招募说明书更新摘要 2012 年第 2 次 2012-8-9
- 9、招商深证 TMT50ETF 招募说明书更新 2012 年第 2 次 2012-8-9
- 10、招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 2012-7-28
- 11、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金 2012 年第 2 季度报告 2012-7-19

二十四、招募说明书的存放及查阅方式

（一）招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构和注册登记人的住所，并刊登在基金管理人、基金托管人的网站上。

（二）招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

二十五、备查文件

投资者如果需了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件：

- 1、中国证监会核准深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、招商基金管理有限公司业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、中国银行股份有限公司业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件