

# 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资 基金 2016 年第 1 号更新招募说明书

## 重要提示

(一) 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《上证 180 等权重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”)及其他有关规定募集,并经中国证监会 2012 年 1 月 21 日证监许可【2012】103 号文核准募集,本基金基金合同于 2012 年 6 月 12 日正式生效。

(二) 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。

(三) 投资有风险,投资人认购、申购基金时应认真阅读本招募说明书。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(五) 基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(六) 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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(七) 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,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,对认购和/或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括但不限于:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因收支违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特定风险。本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

(八) 本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 12 月 12 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 9 月 30 日。本更新招募说明书中财务数据未经审计。

**基金管理人:景顺长城基金管理有限公司**

**基金托管人:中国银行股份有限公司**

## 目 录

一、绪言	3
二、释义	4
三、基金管理人	10
四、基金托管人	23
五、相关服务机构	25
六、基金的募集	31
七、基金合同的生效	38
八、基金份额折算与变更登记	40
九、基金份额的交易	41
十、基金份额的申购和赎回	43
十一、基金的投资	54
十二、基金的业绩	64
十三、基金的融资、融券	66
十四、基金的财产	67
十五、基金资产估值	68
十六、基金的收益与分配	72
十七、基金的费用与税收	74
十八、基金的会计与审计	77
十九、基金的信息披露	78
二十、风险揭示	82
二十一、基金合同的变更、终止与清算	85
二十二、基金合同的内容摘要	88
二十三、基金托管协议的内容摘要	109
二十四、对基金份额持有人的服务	119
二十五、其他应披露事项	121
二十六、招募说明书的存放及其查阅方式	121
二十七、备查文件	122

## 一、绪言

本基金由景顺长城基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其它有关规定募集。

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》以及基金合同等编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、投资策略、风险、费率、管理等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本招募说明书。

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

招募说明书或本招募说明书	指《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
基金合同	指《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
基金份额发售公告	指《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》；
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于 2004 年 6 月 1 日起施行，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《运作办法》	指 2014 年 7 月 7 日由中国证监会公布并于 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《销售办法》	指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》	指 2004 年 6 月 8 日由中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时做出的修订；
元	指人民币元；
基金或本基金	指上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金；
托管协议	指《上证 180 等权重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；

中国证监会	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会；
中国	指中华人民共和国(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)；
基金管理人	指景顺长城基金管理有限公司；
基金托管人	指中国银行股份有限公司；
交易型开放式指数 证券投资基金	《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》所定义的“交易型开放式指数基金”，亦称“ETF (Exchange Traded Fund)”或者“ETF 基金”，即指经依法募集的、投资特定证券指数所对应组合证券的开放式基金，其基金份额用组合证券进行申购、赎回，并在上海证券交易所上市交易；
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；
申购赎回代理券商	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由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；
注册登记业务	指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金登记、存管、过户、清算和交收业务；
注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司；
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接受基金管理人委托，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构及申购赎回代理券商；
发售代理机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；

销售机构	指基金管理人及基金代销机构；
基金销售网点	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
基金网上交易系统	指代销机构的网上交易系统；
投资者	指个人投资者、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证券投资基金的其他投资者；
个人投资者	指依据中国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
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暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会	指按照基金合同第十一部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金合同生效日	指本基金募集结束，基金管理人募集的基金份额总额、募集资金金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
基金募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；

T+n 日	指 T 日后（不包含 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
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由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户	指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认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
认购	指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购	指在基金合同生效后的存续期间，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
赎回	指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件申请将其持有的基金份额兑换为基金合同约定的对价资产的行为；
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	指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、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	指中证指数有限公司编制并发布的上证 180 等权重指数及其未来可能发生的变更；
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

	<p>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；</p>
最小申购、赎回单位	<p>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；</p>
基金份额参考净值	<p>指上海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；</p>
预估现金部分	<p>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，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结；</p>
完全复制法	<p>指一种跟踪指数的投资方法，即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；</p>
收益分配基准日	<p>指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日；</p>
基金净值增长率	<p>指收益分配基准日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；</p>
标的指数同期增长率	<p>指收益分配基准日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；</p>
指令	<p>指基金管理人在管理和运作基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；</p>
基金利润	<p>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；</p>
基金资产总值	<p>指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以</p>



	其他资产等形式存在的基金财产价值总和；
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
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；
法律法规	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该法律法规的不时修改和补充；
不可抗力	指基金合同当事人无法预见、无法避免、无法克服且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本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、恐怖袭击、传染病传播、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；
指定媒体	指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或其它媒体。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

法定代表人：赵如冰

批准设立文号：证监基金字【2003】76号

设立日期：2003年6月12日

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

电话：(0755) 82370388

客户服务电话：4008888606

传真：(0755) 22381339

联系人：杨皞阳

#### （二）基金管理人基本情况

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。

公司设立了两个专门机构：风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门：股票投资部、固定收益部、国际投资部、量化及ETF投资部、专户投资部、研究部、渠道销售部、机构客户部、ETF销售部、市场服务部、产品开发部、交易管理部、基金事务部、信息技术部、人力资源部、财务行政部、法律监察稽核部、总经理办公室。各部门的职责如下：

1、股票投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票选择和组合的投资管理。

2、固定收益部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内债券选择和组合的投资管理并完成固定收益的研究。

3、国际投资部：主要负责与QDII、QFII等国际业务相关的投资管理、国际合作和培训

等业务。

4、量化及ETF投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则，以严谨的量化投资流程为依托，负责各类主动和被动量化产品的投资管理。

5、专户投资部：负责完成一对一、一对多等特定客户资产管理产品的投资管理。

6、研究部：负责对宏观经济、行业公司及市场的研究。

7、渠道销售部：负责公司产品在各银行、券商等渠道的销售。

8、机构客户部：负责开发机构客户，并使其认识并了解我公司在企业年金、社保等方面所提供的基金产品及服务。

9、ETF销售部：负责公司ETF类产品的销售及服务。

10、市场服务部：负责公司市场营销策略、计划制定及推广，电子商务和客户服务管理等工作。

11、产品开发部：负责基金产品及其他投资产品的设计、开发、报批等工作。

12、基金事务部：负责公司产品的注册登记、清算和估值核算等工作。

13、信息技术部：负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。

14、交易管理部：负责完成投资部下发的交易指令，并进行事前的风险控制。

15、人力资源部：负责公司各项人力资源管理工作，包括招聘、薪资福利、绩效管理、培训、员工关系、从业资格管理、高管及基金经理资格管理等。

16、财务行政部：负责公司财务管理及日常行政事务管理。

17、法律监察稽核部：负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。

18、总经理办公室：主要受总经理委托，协调各部门的工作，并负责公司日常办公秩序监督、工作项目管理跟进等，并负责基金风险的评估、控制及管理。

公司已经建立了健全的内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

### （三）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

赵如冰先生，董事长，经济学硕士。曾任葛洲坝水力发电厂主任、研究员级高级工程师，葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站长、书记，葛洲坝水力发电厂办公室主任兼外办主任，华能南方开发公司党组书记、总经理，华能房地产开发公司党组书记、总经理，中住地产开发公司总经理、党组书记，长城证券股份有限公司董事、副董事长、党委副书记等职。2009年加入本公司，现任公司董事长。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House 亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会

管理委员会成员，并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间，担任香港联交所委员会成员，并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

黄海洲先生，董事，工商管理硕士。1992年9月起，历任招商银行股份有限公司深圳蛇口支行会计、工程管理部员工、人力资源部干部，新江南投资公司副总经理。2005年5月起担任长城证券副总经理，现任长城证券副总经理、党委委员。

许义明先生，董事，总经理，金融工程学硕士。曾先后就职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部，汇丰银行中国区财资部；也曾担任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理、香港景顺资产管理有限公司大中华区业务拓展总监等职务。2009年加入本公司，现任公司董事兼总经理。

伍同明先生，独立董事，文学学士（1972年毕业于）。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师事务所”[KPMG]。现为“伍同明会计师事务所”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打打律师行、英国律师行Clyde & Co. 从事律师工作，1993年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

李晓西先生，独立董事。曾任国务院研究室宏观经济研究司司长。现任北京师范大学校学术委员会副主任，教授、博士生导师；中国社会科学院研究生院教授、博士生导师；教育部社会科学委员会经济学部召集人。

## 2、基金管理人监事会成员

王天广先生，监事，金融学学士，注册会计师、律师。1996年7月至1997年8月分别在万科财务顾问公司、中国证监会上市公司监管部工作；1998年起历任中国证监会深圳监管局任副处长、中国银河证券股份有限公司深圳投行部总经理、西南证券股份有限公司总裁助理兼投行总部总经理等职务。2012年2月进入长城证券担任公司副总经理兼投资银行事业部总经理，现任长城证券副总经理、党委委员。

郭慧娜女士，监事，管理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

赵春来先生，监事，经济学硕士。曾担任阳光基金公司研究部研究员；先后任职于国信证券基金债券部、投资管理部、投资研究部、风险监控部、投资管理总部等部门，从事宏观

经济、股票债券研究、行业公司研究，投资业务风险监管，自营投资交易、管理等工作；也曾担任交银施罗德基金交易部交易主管。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

赵如冰先生，董事长，简历同上。

许义明先生，总经理，简历同上。

周伟达先生，副总经理，工商管理硕士。曾担任联博香港有限公司分析员、中国研究总监兼上海代表处首席代表、亚洲（除日本外）增长型股票投资负责人、高级副总裁，友邦保险有限公司上海分公司资产管理中心副总裁。2014 年加入本公司，现任公司副总经理。

康乐先生，副总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011 年加入本公司，现任公司副总经理。

刘奇伟先生，副总经理，工商管理硕士。曾担任上海国际信托投资公司实业部高级项目经理，长盛基金监察稽核部副总经理、上海分公司总经理。2005 年加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003 年加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。历任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003 年加入本公司，曾担任公司督察长，现任公司副总经理。

黄卫明先生，督察长，法学硕士。历任国家工商局市场司主任科员，国泰君安证券公司总裁助理兼人力资源部总经理，中国证监会期货部、非上市公众公司部等主任科员、副处长、处长。2010 年加入本公司，现任公司督察长。

### 4、本基金基金经理简历

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。本基金现任基金经理如下：

徐喻军先生，理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。具有 5 年证券、基金行业从业经验。

## 5、本基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间

无。

## 6、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理徐喻军先生目前兼任景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

## 7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

基金经理姓名	管理时间
江科宏	2012年6月12日—2014年4月18日
徐喻军	2014年4月19日—至今

## 8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

许义明先生，总经理；

周伟达先生，副总经理；

余广先生，股票投资部投资总监；

毛从容女士，固定收益部投资总监；

黎海威先生，量化及ETF投资部投资总监；

刘彦春先生，研究部总监；

杨鹏先生，股票投资部投资副总监兼基金经理。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （四）基金管理人的权利和义务

##### 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）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、基金合同、上海证券交易所及注册登记机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、收益分配等方面的业务规



则：

(4) 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，依照基金合同获得基金管理费，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或监管部门批准的其他收入；

(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；

(9) 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；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 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；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 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价格、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 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；

(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) 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；

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

(19) 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；

(20) 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；

(21) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

(五) 基金管理人承诺



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

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，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) 将基金用于下列投资或者活动：

(i) 承销证券；

(ii) 向他人贷款或者提供担保；

(iii) 从事承担无限责任的投资；

(iv) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(v) 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；

(vi) 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；

(vii) 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；

(viii) 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；

(ix) 证券法规规定禁止从事的其他行为。

3、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权益；

(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；

- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、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) 基金管理人的风险管理和内部控制体系

##### 1、风险管理理念与目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护投资者和股东的合法权益。

##### 2、风险管理措施

- (1) 建立健全公司组织架构；
- (2) 树立监察稽核功能的权威性和独立性；
- (3) 加强内控培训，培养全体员工的风险管理意识和监察文化；
- (4) 制定员工行为规范和纪律程序；
- (5) 建立岗位分离制度；
- (6) 建立危机处理和灾难恢复计划。

##### 3、风险管理和内部控制的原则

- (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：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(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；

(5) 防火墙原则：基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

#### 4、内部控制体系

##### I、内部控制的组织架构

(i) 董事会审计与风险控制委员会：负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。该委员会主要职责是：审议并批准公司内控制度和政策并检查其实施情况；监督公司内部审计制度的实施；向董事会提名外部审计机构；负责内部审计和外部审计之间的协调；审议公司的关联交易；对公司的风险及管理状况及风险管理能力及水平进行评价，提出完善风险管理和内部制度的意见、制定公司日常经营、拟募集基金及运用基金资产进行投资的风险控制指标和监督制度，并不定期地对风险控制情况进行检查和监督，形成风险评估报告和建议，在例行董事会会议上提出公司上半个年度风险控制工作总结报告；监督和指导经理层所设立的风险管理委员会的工作及董事会赋予的其他职责。

(ii) 风险管理委员会：是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，负责公司整体运作风险的评估和控制，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。

(iii) 投资决策委员会：是公司投资领域的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题。投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成，其主要职责包括：依照基金合同、资产管理合

同的规定，确立各基金、特定客户资产管理的投资方针及投资方向；审定基金资产、特定客户资产管理的配置方案，包括基金资产、特定客户资产管理在股票、债券、现金之间的配置比例；制定基金、特定客户资产管理投资授权方案；对超出投资负责人权限的投资项目做出决定；考核包括基金经理、投资经理在内的投资团队的工作绩效；需要投资决策委员会决定的其它重大投资事项。

(iv) 督察长：督察长制度是基金管理人特有的制度。督察长负责组织指导公司的监察稽核工作；可列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核；每月独立出具稽核报告，报送中国证监会和董事长。

(v) 法律、监察稽核部：公司设立法律、监察稽核部，开展公司的监察稽核工作，并保证其工作的独立性和权威性，充分发挥其职能作用。法律、监察稽核部有权对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行检查并提出相应意见和建议，并将意见和建议上报公司总经理、督察长和风险管理委员会进行讨论。法律、监察稽核部协助对全公司员工进行相关法律、法规、规章制度培训，回答公司各部门提出的法律咨询，并对公司出现的法律纠纷提出解决方案，同时组织各部门对公司管理上存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究，提出解决方案，提交风险管理委员会、投资决策委员会或总经理办公会等进行审核、讨论，并监督整改。

## II、内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司设立独立的法律、监察稽核部，法律、监察稽核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；

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制订内部控制制度遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

(2) 全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或

漏洞；

(3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

(4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

### III、内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来，根据中国证监会的要求，借鉴外方股东的经验，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修改，公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

建立健全了管理制度和业务规章：公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易，交易与清算，公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

建立健全了岗位责任制：公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统：公司启用了电子化投资、交易系统，对投资比例进行限制，在“股票黑名单”、交叉交易以及防范操守风险等方面进行电子化自动控制，将有效地防止合规性运作风险和操守风险。

使用数量化的风险管理手段：采用数量化、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、规避和控制，尽可能减少损失。

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，使员工具有较高的职业水准，从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。



## 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

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：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2015年9月30日，中国银行已托管401只证券投资基金，其中境内基金375只，QDII基金26只，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

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014 年,中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

#### (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,及时通知基金管理人,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,应当及时通知基金管理人,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) 基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

##### (1) 长城证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：李春芳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

##### (2) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

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

##### (3) 中国银河证券股份有限公司

注册（办公）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

联系人：邓颜

电话：010-66568292

传真：010-66568990

客户服务电话：4008-888-8888

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

##### (4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

客户服务电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

（5）中信建投证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

联系人：魏明

电话：（010）85130588

传真：（010）65182261

客户服务电话：4008888108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（6）申万宏源证券有限公司

注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

（7）招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

客户服务电话：400-8888-111，95565

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

（8）兴业证券股份有限公司

注册（办公）地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

联系人：柯延超

联系电话：0591-38507950

传真：0591-38507538

客户服务电话:95562

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

（9）光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、4008888788、10108998

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（10）海通证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（11）平安证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法人代表：谢永林

联系人：石静武

电话：021-38631117

传真：021-33830395

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

（12）华福证券有限责任公司

注册（办公）地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

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

（13）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

传真：010-60833739

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（14）长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（15）东方证券股份有限公司

法定代表人：潘鑫军

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户服务热线：95503

公司网站：<http://www.dfzq.com.cn>

（16）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022026

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

## 2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

## 3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减销售本基金的代理机构，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

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：刘永卫

联系电话：021-58872625

### （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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、安冬

联系人：安冬

### （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（特殊普通合伙）

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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：单峰、俞伟敏

## 六、基金的募集

### （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》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2012年1月21日证监许可[2012]103号文核准。

本基金基金合同已于2012年6月12日起正式生效，本基金募集期共募集1,270,455,541.00份基金份额，有效认购户数为8498户。

### （二）基金类型

股票型指数基金

### （三）基金的运作方式

交易型、开放式

### （四）标的指数

上证180等权重指数

### （五）基金存续期间

不定期

### （六）基金份额初始面值

本基金基金份额的初始面值为人民币1.00元

### （七）基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于2亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于2亿元人民币。

### （八）募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；

网下股票认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。基金管理人和发售代理机

构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表其确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

#### （九）募集场所

本基金通过基金管理人直销柜台和发售代理机构的网点向投资者公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况变更、增加或减少发售代理机构，并另行公告。

#### （十）募集期限

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，具体发售时间见基金份额发售公告。

本基金的发售方式有三种：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。投资者认购应提交的文件和办理的手续详见基金份额发售公告。

#### （十一）募集对象

本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### （十二）认购开户

投资者认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。

（1）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

1) 基金账户只能进行基金的二级市场交易，如投资者需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立 A 股账户。

2) 开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

（2）如投资者已开立证券账户，则应注意：

1) 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（3）使用专用席位的机构投资者则无需办理指定交易。

#### （十三）认购费用



本基金的认购采用份额认购的原则。

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时可按照下表费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时，可参照下表费率结构收取一定的佣金。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

认购份额	认购费率
M < 100 万份	1.00%
100 万份 ≤ M < 500 万份	0.60%
500 万份 ≤ M < 1000 万份	0.30%
M ≥ 1000 万份	1000 元/笔

#### （十四）网上现金认购

##### 1、认购时间

详见基金份额发售公告。

##### 2、认购金额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金 = 认购份额 × 佣金比率

认购金额 = 认购份额 × (1 + 佣金比率)

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金。办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，注册登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：在募集期结束后 3 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

#### （十五）网下现金认购

##### 1、认购时间

详见基金份额发售公告。

## 2、 认购金额和利息折算的份额的计算

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用=认购份额×认购费率

认购金额=认购份额×(1+认购费率)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/基金份额初始面值

认购费用由基金管理人在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3、 认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资者通过基金管理人直销柜台办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上(含 10 万份)。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、 认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、 清算交收：T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于 T+2 日内进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第 4 个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金管理人预先开设的基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资者所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，注册登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 日将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

6、 认购确认：在募集期结束后 3 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

## (十六) 网下股票认购

1、 认购时间：详见基金份额发售公告。

2、 认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报。投资者单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍，用以认购的股票必须是上证 180 等

权重指数成份股和已公告的备选成份股。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

#### 4、特殊情形

(1) 已公告的将被调出上证 180 等权重指数的成份股不得用于认购本基金。

(2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

#### 5、清算交收

投资者通过发售代理机构办理网下股票认购的，在网下股票认购最后一日，发售代理机构将汇总的股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，网下股票认购最后一日，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。注册登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者账户内相应的股票进行冻结。基金募集期结束，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。注册登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资者申请认购的股票过户到基金的证券账户。

#### 6、网下股票认购份额的计算公式

$$\text{投资者的认购份额} = \frac{\sum_{i=1}^n (\text{第}i\text{只股票在股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量})}{1.00}$$

其中，

(1)  $i$  代表投资者提交认购申请的第  $i$  只股票，如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则  $i=1$ ， $i \leq 180$ 。

(2) “第  $i$  只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据上海证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则由于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

①除息:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

②送股:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/(1+每股送股比例)

③配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股配股比例)

④送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

⑤除息、送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

(3)“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中,

①对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限为:

$$q^{\max} = \frac{\left( \text{Cash} + \sum_{j=1}^n p_j q_j \right) \times 105\% \times w}{P}$$

$q^{\max}$  为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量,  $\text{Cash}$  为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额,  $p_j q_j$  为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其它个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积,  $w$  为该限制认购规模的个股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日在标的指数中的权重(认购期间如有标的指数调整公告,则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的各成份股构成权重,并以其作为计算依据),  $P$  为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

②若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行,基金管理人将根据注册登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

(十七) 募集资金利息及募集股票权益的处理

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在划入基金募集专户前所产生的利息，归投资者所有；有效认购资金自划入基金募集专户起至基金合同生效日止的利息计入基金资产；投资者以股票认购的，认购股票由注册登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。

#### （十八）募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

募集的股票由注册登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至基金的证券账户。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金募集期限届满或基金管理人提前结束募集时，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于2亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于200人。

### （二）基金的备案

基金募集期限届满或基金管理人提前结束募集时，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### （三）基金合同的生效

本基金的基金合同已于2012年6月12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。

### （四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息；
- 3、对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，注册登记机构将按照其规则予以解冻。

### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元

的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 八、基金份额折算与变更登记

### （一）基金份额折算的时间

在本基金份额上市后，为了更好的跟踪标的指数，基金管理人将根据运作情况决定是否对基金份额进行折算。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向登记结算机构申请办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。

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。

### （三）基金份额折算的方法

对基金份额折算后的基金份额持有人持有的基金份额计算至整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产），加总得到折算后的基金总份额。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。本基金管理人将根据折算比例调整最小申购赎回单位等安排。



## 九、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《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

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

基金份额上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金份额上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

本基金于2012年7月9日起在上海证券交易所上市交易，二级市场交易代码：510420。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海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，上海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、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海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。

#### （四）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向上海证券交易所提供当日的申购、赎回清单，上海证券交易所开市后根据申购、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、上海证券交易所可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

## 十、基金份额的申购和赎回

### （一）申购与赎回的场所

投资者可以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，并予以公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、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上海证券交易所交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 13:00-15:00。投资者应当在开放日办理申购和赎回申请，在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。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。

若出现上海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并公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金基金合同于 2012 年 6 月 12 日起正式生效。根据《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本公司已于 2012 年 7 月 9 日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。

### （三）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 100 万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （四）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《上海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权益的情况下可更改上述原则，但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。

#### （五）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金时，须根据申购赎回清单备足申购对价。

投资者提交赎回申请时，其必须有足够的基金份额余额和现金。

##### 2、申购与赎回申请的确认

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。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。

##### 3、申购与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上海证券交易所和注册登记机构的结算规则。

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基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在 T+1 日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人在 T+2 日办理现金差额的交收。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，并最迟于开始实施日的 3 个工作日前在指定媒体公告。

#### （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赎回人的组合证券、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上海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内各成份证券数据、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：出于证券停牌等原因导致投资人无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

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×该证券参考价格×(1+现金替代溢价比例)

其中，“参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，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参考价格可能有所差异。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，上海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)、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，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及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

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：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第}i\text{支替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格} \times 100\%}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}(IOPV)}$$

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所



交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。参考基金份额净值目前为该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### (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 T 日预计开盘价。

### 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：

$$T \text{ 日预估现金部分} = T-1 \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日预计开盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日预计开盘价相乘之和})$$

其中，T 日预计开盘价主要根据上海证券交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。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。预估现金部分的数值可能为正、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：

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

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

T 日申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息					
最新公告日期	2015-12-14				
基金名称					
基金管理公司名称					
一级市场基金代码					
T-1 日信息内容					
现金差额（单位：元）					
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）					
基金份额净值（单位：元）					
T 日信息内容					
预估现金部分（单位：元）					
可以现金替代比例上限					
是否需要公布 IOPV					
最小申购赎回单位（单位：份）					
申购、赎回的允许情况					
T 日成份股信息内容					
股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢比价率	固定替代金额
600000	浦发银行		允许	10.00%	
600005	武钢股份		允许	10.00%	
600010	包钢股份		允许	10.00%	
600011	华能国际		允许	10.00%	
600015	华夏银行		允许	10.00%	
600016	民生银行		允许	10.00%	
600018	上港集团		允许	10.00%	
600019	宝钢股份		允许	10.00%	
600021	上海电力		允许	10.00%	
600023	浙能电力		允许	10.00%	
600027	华电国际		允许	10.00%	
600028	中国石化		允许	10.00%	
600029	南方航空		允许	10.00%	
600030	中信证券		允许	10.00%	
600031	三一重工		允许	10.00%	
600036	招商银行		允许	10.00%	
600037	歌华有线		允许	10.00%	
600048	保利地产		允许	10.00%	
600050	中国联通		允许	10.00%	
600060	海信电器		允许	10.00%	

600064	南京高科		允许	10.00%	
600066	宇通客车		允许	10.00%	
600067	冠城大通		允许	10.00%	
600068	葛洲坝		允许	10.00%	
600085	同仁堂		允许	10.00%	
600089	特变电工		允许	10.00%	
600094	大名城		允许	10.00%	
600100	同方股份		允许	10.00%	
600104	上汽集团		允许	10.00%	
600108	亚盛集团		允许	10.00%	
600109	国金证券		允许	10.00%	
600111	北方稀土		允许	10.00%	
600115	东方航空		允许	10.00%	
600118	中国卫星		允许	10.00%	
600150	中国船舶		允许	10.00%	
600153	建发股份		允许	10.00%	
600157	永泰能源		允许	10.00%	
600158	中体产业		允许	10.00%	
600170	上海建工		允许	10.00%	
600177	雅戈尔		允许	10.00%	
600185	格力地产		允许	10.00%	
600196	复星医药		允许	10.00%	
600208	新潮中宝		允许	10.00%	
600219	南山铝业		允许	10.00%	
600221	海南航空		允许	10.00%	
600240	华业资本		允许	10.00%	
600252	中恒集团		允许	10.00%	
600256	广汇能源		允许	10.00%	
600266	北京城建		允许	10.00%	
600271	航天信息		允许	10.00%	
600276	恒瑞医药		允许	10.00%	
600309	万华化学		允许	10.00%	
600315	上海家化		允许	10.00%	
600316	洪都航空		允许	10.00%	
600325	华发股份		允许	10.00%	
600332	白云山		允许	10.00%	
600340	华夏幸福		允许	10.00%	
600352	浙江龙盛		允许	10.00%	
600362	江西铜业		允许	10.00%	
600369	西南证券		允许	10.00%	
600372	中航电子		允许	10.00%	
600376	首开股份		允许	10.00%	
600383	金地集团		允许	10.00%	

600406	国电南瑞		允许	10.00%	
600415	小商品城		允许	10.00%	
600435	北方导航		允许	10.00%	
600485	信威集团		允许	10.00%	
600489	中金黄金		允许	10.00%	
600490	鹏欣资源		允许	10.00%	
600503	华丽家族		允许	10.00%	
600516	方大炭素		允许	10.00%	
600518	康美药业		允许	10.00%	
600519	贵州茅台		允许	10.00%	
600535	天士力		允许	10.00%	
600547	山东黄金		允许	10.00%	
600570	恒生电子		允许	10.00%	
600583	海油工程		允许	10.00%	
600585	海螺水泥		允许	10.00%	
600588	用友网络		允许	10.00%	
600597	光明乳业		允许	10.00%	
600633	浙报传媒		允许	10.00%	
600637	东方明珠		允许	10.00%	
600638	新黄浦		允许	10.00%	
600639	浦东金桥		允许	10.00%	
600643	爱建集团		允许	10.00%	
600645	中源协和		允许	10.00%	
600649	城投控股		允许	10.00%	
600660	福耀玻璃		允许	10.00%	
600663	陆家嘴		允许	10.00%	
600674	川投能源		允许	10.00%	
600688	上海石化		允许	10.00%	
600690	青岛海尔		允许	10.00%	
600703	三安光电		允许	10.00%	
600705	中航资本		允许	10.00%	
600717	天津港		允许	10.00%	
600718	东软集团		允许	10.00%	
600739	辽宁成大		允许	10.00%	
600741	华域汽车		允许	10.00%	
600748	上实发展		允许	10.00%	
600773	西藏城投		允许	10.00%	
600795	国电电力		允许	10.00%	
600804	鹏博士		允许	10.00%	
600816	安信信托		允许	10.00%	
600820	隧道股份		允许	10.00%	
600823	世茂股份		允许	10.00%	
600827	百联股份		允许	10.00%	

600837	海通证券		允许	10.00%	
600839	四川长虹		允许	10.00%	
600867	通化东宝		允许	10.00%	
600873	梅花生物		允许	10.00%	
600875	东方电气		允许	10.00%	
600886	国投电力		允许	10.00%	
600887	伊利股份		允许	10.00%	
600893	中航动力		允许	10.00%	
600895	张江高科		允许	10.00%	
600900	长江电力		允许	10.00%	
600958	东方证券		允许	10.00%	
600959	江苏有线		允许	10.00%	
600998	九州通		允许	10.00%	
600999	招商证券		允许	10.00%	
601006	大秦铁路		允许	10.00%	
601009	南京银行		允许	10.00%	
601018	宁波港		允许	10.00%	
601088	中国神华		允许	10.00%	
601099	太平洋		允许	10.00%	
601106	中国一重		允许	10.00%	
601111	中国国航		允许	10.00%	
601117	中国化学		允许	10.00%	
601118	海南橡胶		允许	10.00%	
601166	兴业银行		允许	10.00%	
601169	北京银行		允许	10.00%	
601179	中国西电		允许	10.00%	
601186	中国铁建		允许	10.00%	
601198	东兴证券		允许	10.00%	
601211	国泰君安		允许	10.00%	
601216	君正集团		允许	10.00%	
601258	庞大集团		允许	10.00%	
601288	农业银行		允许	10.00%	
601318	中国平安		允许	10.00%	
601328	交通银行		允许	10.00%	
601333	广深铁路		允许	10.00%	
601336	新华保险		允许	10.00%	
601377	兴业证券		允许	10.00%	
601390	中国中铁		允许	10.00%	
601398	工商银行		允许	10.00%	
601555	东吴证券		允许	10.00%	
601588	北辰实业		允许	10.00%	
601600	中国铝业		允许	10.00%	
601601	中国太保		允许	10.00%	

601607	上海医药		允许	10.00%	
601608	中信重工		允许	10.00%	
601618	中国中冶		允许	10.00%	
601628	中国人寿		允许	10.00%	
601633	长城汽车		允许	10.00%	
601668	中国建筑		允许	10.00%	
601669	中国电建		允许	10.00%	
601688	华泰证券		允许	10.00%	
601718	际华集团		允许	10.00%	
601727	上海电气		允许	10.00%	
601766	中国中车		允许	10.00%	
601788	光大证券		允许	10.00%	
601800	中国交建		允许	10.00%	
601808	中海油服		允许	10.00%	
601818	光大银行		允许	10.00%	
601857	中国石油		允许	10.00%	
601872	招商轮船		允许	10.00%	
601898	中煤能源		允许	10.00%	
601899	紫金矿业		允许	10.00%	
601901	方正证券		允许	10.00%	
601919	中国远洋		允许	10.00%	
601928	凤凰传媒		允许	10.00%	
601929	吉视传媒		允许	10.00%	
601933	永辉超市		允许	10.00%	
601939	建设银行		允许	10.00%	
601985	中国核电		允许	10.00%	
601988	中国银行		必须		
601989	中国重工		允许	10.00%	
601992	金隅股份		允许	10.00%	
601998	中信银行		允许	10.00%	
603993	洛阳钼业		允许	10.00%	

#### (八) 暂停申购、赎回的情形及处理

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购、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、上海证券交易所决定临时停市或在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、上海证券交易所、申购赎回代理券商、注册登记机构等因异常情况无法办理申购或赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

- 4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、停牌成份股合计占标的指数的权重超过5%；
- 6、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某些或某笔申购；
- 7、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购或赎回的，基金管理人应在当日报中国证监会备案。本基金因除上述第6项之外的其他情形暂停申购或赎回的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购或赎回公告。已确认的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。

#### (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。非交易过户等业务，参照中国证券登记结算有限责任公司的《证券登记规则》执行。

#### (十) 基金认购、申购和赎回等业务的代理

本基金的认购、申购、赎回等业务可由基金管理人及基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金网下认购、申购、赎回等业务的，应与其签订书面委托代理协议，以明确双方的权利和义务。

基金管理人和代销机构应严格按照法律法规和基金合同的规定办理本基金的认购、申购和赎回等业务。

## 十一、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的最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

### （三）投资策略

#### 1、股票资产指数化投资策略

本基金以上证 180 等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以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为原则，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。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使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%。

#### 2、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以内的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 3、权证投资策略

本基金在权证投资中将对其标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权



证策略等。

#### （四）投资组合管理

本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证 180 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制,实现对标的指数的紧密跟踪。

##### 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、指数编制方法发生变更

基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资组合调整。

##### 3、成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等),以及成份股公司其他重大信息,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、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。

##### 5、申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。

##### 6、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其原因,并优化跟踪偏离度管理方案,同时设置风险隐患预警机制,及时控制跟踪偏离度和跟踪误差。

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%。如因标的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）投资决策流程

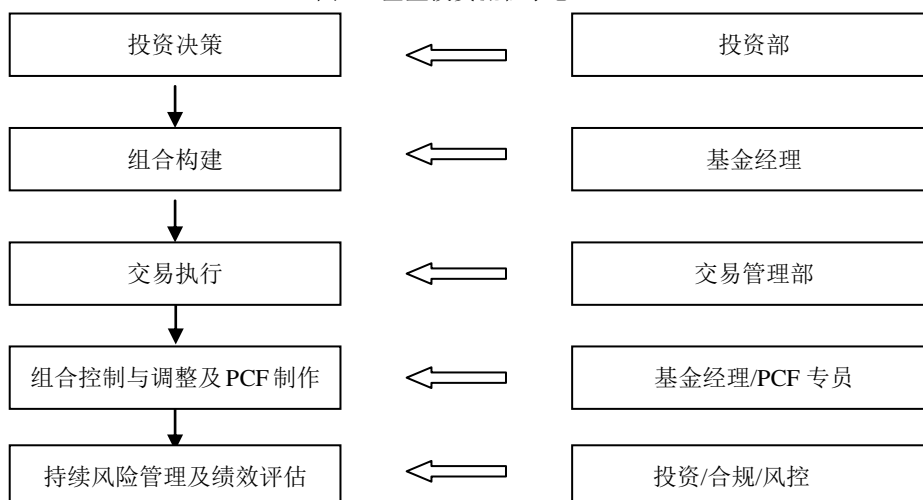
投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题，包括确立各基金的投资方针及投资方向，审定基金财产的配置方案。投资决策委员会召开前，由基金经理依据对宏观经济走势的分析，提出基金的资产配置建议，交由投资决策委员会讨论。一旦做出决议，即成为指导基金投资的正式文件，投资部据此拟订具体的投资计划。

投资研究部是负责管理基金日常投资活动的具体部门，分管投资的副总经理除履行投资决策委员会执行委员的职责外，还负责管理和协调投资研究部的日常运作。投资研究联席会议是投资研究部常设议事机构，负责讨论行业信息、个股信息、回顾行业表现、行业配置、模拟组合表现、近期研究计划及成果、市场热点、当日投资决策、代行表决权、投资备选库调整等问题。投资研究部主要负责宏观经济研究、行业研究和投资品种研究，负责编制、维护投资备选库，建立、完善、管理并维护股票研究数据库与债券研究资料库，并为投资决策委员会、投资研究联席会议、分管投资的副总经理、各投资总监和基金经理提供基金投资决策依据。投资研究部负责根据投资决策委员会决议，负责基金投资组合的构造、优化、风险管理及头寸管理等日常工作；拟订基金的总体投资策略、资产配置方案、重大投资项目提案和投资组合方案等并上报投资决策委员会讨论决定；组织实施投资决策委员会及投资研究联席会议决定的投资方案并在授权范围内作出投资决定；依据自主的研究积极把握市场动态，积极提出基金投资组合优化方案，并对管理基金的投资业绩负责。其中基金经理根据投资决策委员会及投资研究联席会议决议具体承担本基金的日常管理工作。

风险管理委员会是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，负责公司整体运作风险的评估和控制，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。绩效评估与风险控制人员负责建立和完善投资风险管理系统，并负责对基金历史业绩进行分解和分析。法律监察稽核部负责基金日常运作的合规控制。

## 投资决策流程

图 1 基金投资流程示意



(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基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。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。交易管理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，同时 PCF 专员制作下一交易日 PCF 清单。

(5) 持续风险管理及绩效评估。基金经理及风险管理人员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。风险管理管理人员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。

#### （六）标的指数

本基金的标的指数为上证 180 等权重指数（指数代码为 000051）。

上证 180 等权重指数是由中证指数公司编制并发布。上证 180 等权重指数与上证 180 指数拥有相同的成份股，由上海证券交易所市场上 180 支股票组成。上证 180 等权重指数采用了等权重加权。上证 180 等权重指数的个股与行业权重分布更为均匀，为投资者提供了新的投资性标的。

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本系列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。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

#### （七）业绩比较基准

本基金业绩比较基准=上证 180 等权重指数。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的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本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，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。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。

#### （八）风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### （九）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （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的除外；
- (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；
- (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、行政法规有关法律法规规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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。对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资标的指数成份股或备选成份股的，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。

## 2、基金投资组合比例限制

(1) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

(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) 本基金不得违反基金合同的投资比例的约定；

(4) 法律法规的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

### (十) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

### (十一) 基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的原则及方法：

- (1) 不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- (2) 有利于本基金财产的安全和增值；



- (3) 独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- (4) 基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使股东和债权人权利。

(十二) 基金投资组合报告；

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

基金托管人中国银行根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至2015年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	215,348,796.27	98.32
	其中：股票	215,348,796.27	98.32
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,662,656.68	1.67
7	其他资产	19,700.54	0.01
8	合计	219,031,153.49	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末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	2,193,294.05	1.00
B	采矿业	14,826,142.25	6.78
C	制造业	70,153,844.96	32.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,012,934.69	5.04
E	建筑业	8,767,176.36	4.01
F	批发和零售业	7,027,192.72	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	12,170,688.29	5.57

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,573,191.57	4.38
J	金融业	41,135,706.97	18.82
K	房地产业	27,583,282.52	12.62
L	租赁和商务服务业	871,624.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	2,843,069.56	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,911,618.97	2.25
S	综合	2,279,029.36	1.04
	合计	215,348,796.27	98.55

## 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	600649	城投控股	286,482	3,664,104.78	1.68
2	600645	中源协和	35,834	2,843,069.56	1.30
3	600499	科达洁能	77,950	2,310,438.00	1.06
4	600016	民生银行	248,443	2,099,343.35	0.96
5	600276	恒瑞医药	44,762	2,067,556.78	0.95
6	600643	爱建股份	114,854	1,921,507.42	0.88
7	600519	贵州茅台	9,842	1,873,031.02	0.86
8	600000	浦发银行	111,053	1,846,811.39	0.85
9	603288	海天味业	55,482	1,740,470.34	0.80
10	600036	招商银行	97,180	1,726,888.60	0.79

### 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序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序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

##### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11. 投资组合报告附注

##### 11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,720.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	855.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.16
8	其他	-
9	合计	19,700.54

## 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 11.5.1 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	600645	中源协和	2,843,069.56	1.30	重大事项停牌
2	600499	科达洁能	2,310,438.00	1.06	重大事项停牌
3	600643	爱建股份	1,921,507.42	0.88	重大事项停牌

### 11.5.2 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。

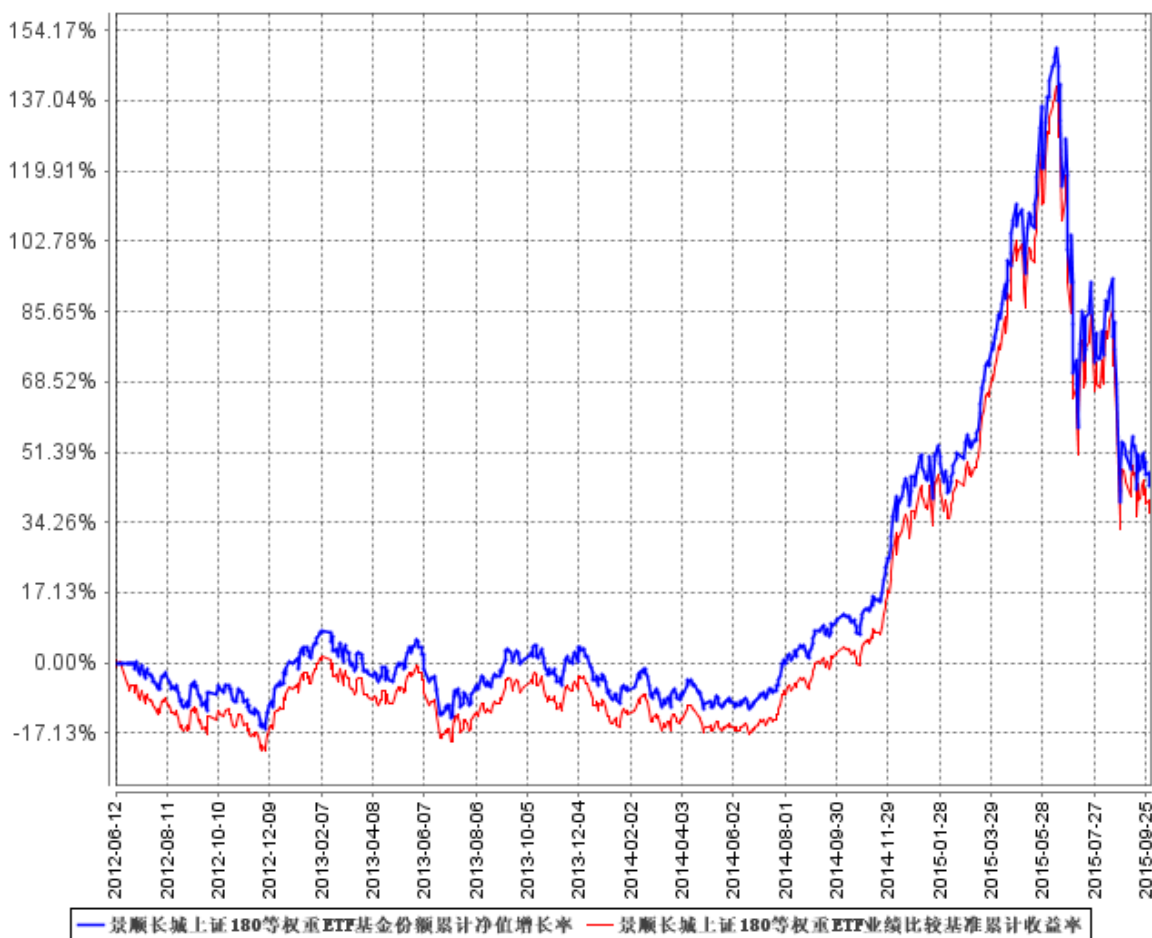
## 十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2015年9月30日。

### 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
2012年6月12日 -2012年12月31日	0.20%	1.26%	-6.05%	1.34%	6.25%	-0.08%
2013年	-3.19%	1.37%	-3.38%	1.39%	0.19%	-0.02%
2014年	50.62%	1.17%	52.11%	1.19%	-1.49%	-0.02%
2015年1月1日 -2015年9月30日	-1.23%	2.84%	-0.32%	2.88%	-0.91%	-0.04%
2012年6月12日 -2015年9月30日	44.30%	1.75%	37.63%	1.78%	6.67%	-0.03%

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



注：本基金的资产配置比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2012年6月12日基金合同生效日起3个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 十三、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十四、基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

### （二）基金资产净值

本基金的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、规范性文件开立基金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独立。

### （四）基金财产的保管与处分

- 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，归基金财产。
- 3、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。
- 4、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （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）估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

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；

##### （2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

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，确定公允价值。

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的情况下，按成本估值。

##### （3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

#### 2、固定收益证券的估值办法

##### （1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)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，按最近交易日的净价估值；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。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价格，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 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。

(5) 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。

(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。

### 3、权证估值：

#### (1) 配股权证的估值：

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。

#### (2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。合同利率与实际利率差异较小时，也可以采用合同利率计算应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述1-5项规定的方法对基金财产进行估值，均应

被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可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的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

#### （五）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。基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将估值结果发送至基金托管人，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返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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）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、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财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

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，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后3位（含第3位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当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资产净值的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资产份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十六、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指从基金上市日截至收益分配基准日基金份额净值增长率与标的指数同期增长率的差额乘以基金上市前一日基金份额净值乘以基金收益分配基准日发售在外的基金份额总额所得到的总额。

基金净值增长率为收益分配基准日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益分配基准日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

### （三）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配采用现金方式；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多12次；每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。若基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 4、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；
- 5、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，收益分配后有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；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （四）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益分配基准日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率，并计算基金净值增长率与标的指数净值增长率的差额，当差额超过1%时，基金管理人有权进行

收益分配。

2、基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

3、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基金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

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后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

在分配方案公布后，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。

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

基金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。

## 十七、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

- 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、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

### （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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。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

基金托管费每日计提，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。

### 3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000）。

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付。

由于指数公司保留变更或提高指数使用费的权利，如果指数使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4、本章第（一）款第 4 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### （三）与基金销售有关的费用

#### 1、认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时可按照下表费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时，可参照下表费率结构收取一定的佣金。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

认购份额	认购费率
M < 100 万份	1.00%
100 万份 ≤ M < 500 万份	0.60%
500 万份 ≤ M < 1000 万份	0.30%
M ≥ 1000 万份	1000 元/笔



## 2、申购与赎回的对价、费用

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赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

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上海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。

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。

### （四）不列入基金费用的项目

本章第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

### （五）费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十八、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、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 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、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，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以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 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等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，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。
- 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。

## 十九、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（以下简称“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、基金托管人应当同时将基金合同、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报刊和网站上登载基金合同生效公告。

### （四）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。

### （五）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。

### （六）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述最后一个市场交易日的次日，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网站上。

#### （七）基金申购赎回清单

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）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。

#### （九）临时报告

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百分之五十；
- 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百分之三十；
- 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百分之零点五；
- 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、基金暂停接受申购、赎回申请；
- 24、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 25、基金变更标的指数；
- 26、基金暂停上市、恢复上市或者终止上市；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （十）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。

（十一）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。

## 二十、风险揭示

### （一）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

债券、票据等在偿付本息后或回购到期后获得的资金可能由于市场利率的下降面临再投资的收益率低于原来利率，由此可能使本基金面临收益下降的局面，产生再投资风险。

#### 5、信用风险

本基金所投资的债券票据的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，以及由于债券票据发行人信用质量降低会导致价格下降，造成基金资产损失的可能性。

#### 6、本基金特有风险

##### （1）指数化投资的风险

ETF 作为股票指数基金，在投资管理中会至少维持 95% 的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能规避市场下跌的风险和个股风险。

##### （2）跟踪误差的风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪基准之间的偏离程度，是控制投资组合与基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。以下原因可能会影



响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

- 1) 标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- 2) 标的指数成份股的调整；
- 3) 基金现金资产的拖累；
- 4) 基金的管理费和托管费带来的跟踪误差；
- 5) 指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；
- 6) 由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差。

#### (3) 二级市场折溢价风险

ETF 二级市场的价格受供需关系的影响，可能高于或低于基金的份额净值，形成溢价交易或折价交易。

#### (4) 二级市场流动性风险

ETF 可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

#### (5) 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。

### (二) 流动性风险

指基金资产不能迅速、低成本地转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。前者是指资产不能及时变现或无法按照正常的市场价格交易而引起损失的可能性。为应付投资者的赎回，基金资产需保持一定的流动性，从而在收益性方面可能会有些损失，影响基金投资目标的实现。后者是指在基金交易过程中，可能会发生大额赎回的情形，大额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险。

### (三) 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。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### (四) 操作或技术风险

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

#### （五）合规性风险

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

#### （六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统出现问题产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展但在人员配备、内控等方面不完善而产生的风险；
- 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损失并影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 二十一、基金合同的变更、终止与清算

### （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并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，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；

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、法律法规和基金合同规定的其他情形。

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。

### （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组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

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

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

### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 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。

### 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

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及其权利义务

#### (一) 基金管理人

##### 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) 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、基金合同、上海证券交易所及注册登记机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 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，依照基金合同获得基金管理费，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或监管部门批准的其他收入；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期内，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；
- (7) 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；
- (8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；
- (9) 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；
- (10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (12) 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；

- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 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；
- (15) 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；
- (16) 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价格、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；
- (12) 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；
- (13) 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；
- (14) 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；
- (15) 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；

(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) 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；

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

(19) 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；

(20) 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；

(21) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人的权利

(1) 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、基金合同规定的其它权利。

### 2、基金托管的义务

(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) 根据法律法规及本合同的约定，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) 建立、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) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因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。

### (三) 基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、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) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金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。

### 3、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、认购股票、申购对价及基金合同规定的费用；

(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、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；

(5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(7) 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；

(8) 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

(一) 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出席会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

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基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金基金份额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。

(二) 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、变更基金份额持有人大会程序；
- 9、本基金与其他基金合并；
- 10、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；
- 11、终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 12、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。

（三）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、基金托管费率和其他应由基金承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 4、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；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、基金管理人、证券交易所、注册登记机构在法律法规或中国证监会许可的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 7、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。

（四）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。基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
- 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%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，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。

#### （五）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在指定媒体上公告。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；
- （4）会务常设联系人姓名、电话；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

2、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。

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，不影响表决意见的计票效力。

#### （六）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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

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、亲自出席会议者出具的身份证明及持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的身份证明及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、本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%，下同）。

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

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额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其他代表，同时提交的身份证明、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应保持不变。

### （七）议事内容与程序

#### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）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。

（3）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：

a、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。

b、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。

（4）单独或合并持有权益登记日基金份额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。

（5）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

#### 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

### （八）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：



### （1）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或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

### （2）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或其代理人所持表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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。

## （九）计票

### 1、现场开会

（1）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的授权代表担任；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。

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

（3）如果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。

（4）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。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下,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监督人(如果基金管理人为召集人,基金托管人为监督人;如果基金托管人为召集人,基金管理人为监督人)派出的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;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证

## (十) 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。

(十一) 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、基金收益与分配

### (一) 基金利润的构成

基金利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指从基金上市日截至收益分配基准日基金份额净值增长率与标的指数同期增长率的差额乘以基金上市前一日基金份额净值乘以基金收益分配基准日发售在外的基金份额总额所得到的总额。

基金净值增长率为收益分配基准日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100% (期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);

标的指数同期增长率为收益分配基准日的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

### （三）收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配采用现金分红方式；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。若基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 4、当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配；
- 5、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，收益分配后有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；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （四）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益分配基准日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率，并计算基金净值增长率与标的指数净值增长率的差额，当差额超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。

2、基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

3、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基金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与公告

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后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

在分配方案公布后，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。

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）收益分配中发生的费用

基金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。

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数许可使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

#### （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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。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

基金托管费每日计提，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。

### 3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数使用费。指数使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000）。

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付。

由于指数公司保留变更或提高指数使用费的权利，如果指数使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4、本条第（一）款第3至第11项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

#### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 五、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的最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

### （三）投资策略

#### 1、股票资产指数化投资策略

本基金以上证180等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以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为原则，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。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使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%。

#### 2、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以内的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 3、权证投资策略

本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。



#### （四）投资组合管理

本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在上证 180 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制,实现对标的指数的紧密跟踪。

##### 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、指数编制方法发生变更

基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资组合调整。

##### 3、成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等),以及成份股公司其他重大信息,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、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。

##### 5、申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。

##### 6、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,同时设置风险隐患预警机制,及时控制跟踪偏离度和跟踪误差。

在正常情况下,本基金力争使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%。如因标的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）标的指数

本基金的标的指数为上证 180 等权重指数（指数代码为 000051）。

上证 180 等权重指数是由中证指数公司编制并发布。上证 180 等权重指数与上证 180 指数拥有相同的成份股，由上海证券交易所市场上 180 支股票组成。上证 180 等权重指数采用了等权重加权。上证 180 等权重指数的个股与行业权重分布更为均匀，为投资者提供了新的投资性标的。

随着市场环境的变化，如果上述标的指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本系列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。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

#### （六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准=上证 180 等权重指数。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的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本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，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。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。

#### （七）风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### （八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （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的除外；
- (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；
- (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、行政法规有关法律法规规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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。对于因上述(5)、(6)项情形导致无法投资标的指数成份股或备选成份股的，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。

## 2、基金投资组合比例限制

(1) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

(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) 本基金不得违反基金合同的投资比例的约定；

(4) 法律法规的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## (九) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 六、基金资产净值的计算和公告方式

### (一) 基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款

项和其他投资所形成的价值总和。

## （二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

## （三）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资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网站上。

## 七、基金合同的终止与基金资产的清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 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、法律法规和基金合同规定的其他情形。

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。

### （二）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本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

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

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

### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 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。

### 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

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

### 八、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本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。

(三) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

## 二十三、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（或简称“管理人”）

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层

法定代表人：赵如冰

成立日期：2003年6月12日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】76号

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

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.3亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“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：田国立

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

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，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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

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 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

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 本基金不得违反基金合同的投资比例的约定；

④ 法律法规的其他限制。

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。如法律法规或监管部门变更上述限制性规定，以变更后的规定为准。

（3）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；

（4）基金管理人向基金托管人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，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。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；

2、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。

3、基金托管人在上述第1、2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。

4、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。

5、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) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

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,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,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,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的完整与独立。

(5) 对于因基金认(申)购、基金投资过程中产生的应收财产,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托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担责任。

(6) 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

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时,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》等有关规定的,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基金托管专户中,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，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，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。

(2) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人或注册登记机构按规定办理退款、股票解冻事宜。

### 3、基金的银行账户的开设和管理

(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) 基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

### 4、投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的结算与划付

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、现金差额的结算。现金差额、现金替代的退款和补款由基金托管人根据基金管理人的指令进行划付。

### 5、基金证券账户和结算备付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。

(4) 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。

(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、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后, 基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格, 并代表基金进行交易; 基金托管人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, 并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后, 由基金托管人负责向中国人民银行报备。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议。

#### 7、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。

#### 8、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。

(2) 基金管理人应每工作日对基金财产估值。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工作日结束后计算得出当日的该基金份额净值, 将估值结果通过深证通以 XBRL 文件格式发送至基金托管人。基金托管人复核无误后在 XBRL 文件上进行数字签名, 并将签名后的文件通过深证通返回给基金管理人, 由基金管理人对外公布。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。

(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(含第三位)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资产净值的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) 由于基金管理人对外公布的基金净值数据错误,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) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,基金管理人、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、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。

(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定期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备案。

### 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。

## 二十四、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改以下服务项目：

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金交易记录；

2、每年度结束后 10 个工作日内，基金管理人向留有完整信息的所有持有本基金份额或本年度内发生本基金交易的投资者以书面形式寄送对账单。每季度结束后 10 个工作日内，基金管理人向留有完整信息的本季度内发生本基金交易的投资者以书面形式寄送对账单。每月度结束后 10 个工作日内向定制电子对账单服务且持有本基金份额或本月内发生本基金交易并留有完整信息的投资者以电子邮件或手机短信形式提供对账单。

我公司于 2013 年 11 月 15 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于调整基金对账单寄送服务形式的公告》，自 2013 年 11 月 15 日起，投资者首次开立本公司基金账户并申购本公司旗下基金的，如申购基金的招募说明书中约定以书面形式寄送对账单的，此书面形式将确认为电子邮件形式，本公司将在每期（季度、年度）结束后的 10 个工作日内向投资者发送基金账户对账单或其他重要资料。

因提供的个人信息（包括但不限于姓名、电子邮件地址、邮寄地址、邮编等）不详、错误、变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的，请及时到原基金销售网点或本公司网站办理联系方式变更手续。详询 400-8888-606，或通过本公司网站“在线客服”咨询。

### （二）网络在线服务

基金管理人利用其网站(www.igwfm.com)定期或不定期为投资者提供基金管理人信息、基金产品信息、账户查询、投资策略分析报告、热点问答等服务。投资者可以登陆该网站修改基金查询密码。

对于直销个人客户，基金管理人还将提供网上查询服务。

### （三）客户服务中心（Call Center）电话服务

投资者想要了解交易情况、基金账户余额、基金产品与服务信息或进行投诉等，可拨打基金管理人客户服务电话：400 8888 606（免长途费）。

客户服务中心的人工坐席服务时间为每周一至周五（法定节假日及因此导致的证券交易

所休市日除外) 9:00—17:00。

#### (四) 客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金管理人网站留言栏目、自动语音留言栏目、客户服务中心人工热线、书信、电子邮件等六种不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

基金管理人承诺在工作日收到的投诉,将在下一个工作日内作出回应,在非工作日收到的投诉,将顺延至下一个工作日当日或者次日回复。对于不能及时解决的投诉,基金管理人就投诉处理进度向投诉人作出定期更新。

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

## 二十五、其他应披露事项

2015 年 12 月 9 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分完全被动指数证券投资基金投资关联方证券的公告》

2015 年 10 月 27 日发布《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 3 季度报告》

2015 年 8 月 29 日发布《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告》及《摘要》

2015 年 8 月 19 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金停止在中信证券（浙江）所有代销业务的补充公告》

2015 年 8 月 12 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金停止在中信证券（浙江）所有代销业务的公告》

2015 年 7 月 27 日发布《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 2 号更新招募说明书》及《摘要》

2015 年 7 月 18 日发布《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 2 季度报告》

## 二十六、招募说明书的存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

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。

## 二十七、备查文件

- (一) 中国证监会批准上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三) 证券投资基金登记结算服务协议
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金代销协议
- (八) 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (九) 中国证监会要求的其他文件

景顺长城基金管理有限公司

二〇一六年一月二十六日