

# 易方达深证 100 交易型开放式指数基金 更新的招募说明书

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一六年五月

## 重要提示

本基金根据 2006 年 2 月 15 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达深证 100 交易型开放式指数基金募集申请的批复》（证监基金字[2006]20 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2006 年 3 月 24 日正式生效。

基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地管理和运用本基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者投资于本基金前应认真阅读本《招募说明书》。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 3 月 24 日，有关财务数据截止日为 2015 年 12 月 31 日，净值表现截止日为 2015 年 12 月 31 日。财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪 言 .....	1
二、释 义 .....	2
三、基金管理人 .....	6
(一) 基金管理人基本情况 .....	6
(二) 主要人员情况 .....	6
(三) 基金管理人的职责 .....	10
(四) 基金管理人的承诺 .....	11
(五) 基金管理人的内部控制制度 .....	12
四、基金托管人 .....	15
(一) 基本情况 .....	15
(二) 基金托管部门及主要人员情况 .....	15
(三) 证券投资基金托管情况 .....	15
(四) 托管业务的内部控制制度 .....	16
(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序 .....	16
五、相关服务机构 .....	17
(一) 基金份额销售机构 .....	17
(二) 登记结算机构 .....	29
(三) 律师事务所和经办律师 .....	30
(四) 会计师事务所和经办注册会计师 .....	30
六、基金份额折算、拆分、合并与变更登记 .....	31
(一) 基金份额的折算 .....	31
(二) 基金份额的拆分 .....	31
(三) 基金份额的合并 .....	32
七、基金份额的交易 .....	33
(一) 基金上市 .....	33
(二) 基金份额的上市交易 .....	33
(三) 暂停上市交易 .....	33
(四) 终止上市交易 .....	33
(五) 基金份额参考净值 (IOPV) 的计算与公告 .....	34
八、基金份额的申购、赎回 .....	35

(一) 申购和赎回场所 .....	35
(二) 申购和赎回的开放日及时间.....	35
(三) 场内申购和赎回的数额限制.....	36
(四) 场外申购、赎回的数量限制.....	36
(五) 申购和赎回的原则 .....	36
(六) 场内申购和赎回的程序.....	37
(七) 场外申购和赎回的程序.....	37
(八) 场内申购和赎回的对价及费用.....	38
(九) 场外申购和赎回的价格及费用.....	39
(十) 申购赎回清单的内容与格式.....	40
(十一) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式.....	46
(十二) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形.....	47
(十三) 场外巨额赎回的情形及处理方式.....	47
(十四) 集合申购与其他服务.....	48
(十五) 基金转换 .....	48
(十六) 基金的转托管 .....	48
<b>九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押 .....</b>	<b>49</b>
<b>十、基金的投资 .....</b>	<b>51</b>
(一) 投资目标 .....	51
(二) 投资范围 .....	51
(三) 投资理念 .....	51
(四) 投资策略 .....	51
(五) 投资组合管理 .....	52
(六) 业绩比较基准 .....	54
(七) 风险收益特征 .....	54
(八) 禁止行为 .....	54
(九) 投资限制 .....	55
(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法.....	55
(十一) 基金的融资、融券 .....	55
(十二) 基金投资组合报告(未经审计).....	55
<b>十一、基金的业绩 .....</b>	<b>60</b>
<b>十二、基金的财产 .....</b>	<b>61</b>

(一) 基金财产构成 .....	61
(二) 基金财产的帐户 .....	61
(三) 基金财产的保管与处分 .....	61
<b>十三、基金资产估值 .....</b>	<b>62</b>
(一) 估值目的 .....	62
(二) 估值日 .....	62
(三) 估值对象 .....	62
(四) 估值方法 .....	62
(五) 估值程序 .....	63
(六) 暂停估值的情形 .....	64
(七) 基金份额净值的确认 .....	64
(八) 估值错误的处理 .....	64
(九) 特殊情形的处理 .....	64
<b>十四、基金的收益与分配 .....</b>	<b>65</b>
(一) 收益的构成 .....	65
(二) 收益分配原则 .....	65
(三) 基金收益分配数额的确定原则 .....	65
(四) 收益分配方案 .....	66
(五) 收益分配的确定与公告 .....	66
(六) 场外份额收益分配中发生的费用 .....	66
<b>十五、基金的费用与税收 .....</b>	<b>67</b>
(一) 与基金运作有关的费用 .....	67
(二) 与基金销售有关的费用 .....	68
(三) 基金税收 .....	68
<b>十六、基金的会计与审计 .....</b>	<b>69</b>
(一) 基金会计政策 .....	69
(二) 基金审计 .....	69
<b>十七、基金的信息披露 .....</b>	<b>70</b>
(一) 基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告 .....	70
(二) 基金合同生效公告 .....	70
(三) 基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告 .....	70
(四) 基金份额上市交易公告书 .....	70

(五) 基金份额净值公告、申购赎回清单及申购、赎回价格公告 .....	70
(六) 定期报告 .....	71
(七) 临时报告与公告 .....	71
(八) 信息披露文件的存放与查阅 .....	72
<b>十八、风险揭示 .....</b>	<b>73</b>
(一) 投资于本基金的主要风险 .....	73
(二) 声明 .....	75
<b>十九、基金合同的终止与基金财产的清算 .....</b>	<b>77</b>
(一) 基金合同的终止 .....	77
(二) 基金财产的清算 .....	77
<b>二十、基金合同内容摘要 .....</b>	<b>79</b>
(一) 基金管理人的权利与义务 .....	79
(二) 基金托管人的权利与义务 .....	81
(三) 基金份额持有人的权利与义务 .....	83
(四) 基金份额持有人大会 .....	84
(五) 基金合同的变更和终止 .....	89
(六) 争议的处理 .....	90
(七) 基金合同的存放及查阅方式 .....	90
<b>二十一、基金托管协议的内容摘要 .....</b>	<b>91</b>
(一) 托管协议当事人 .....	91
(二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查 .....	92
(三) 基金财产保管 .....	93
(四) 基金资产的财务处理 .....	95
(五) 基金份额持有人名册的保管 .....	97
(六) 适用法律与争议解决 .....	97
(七) 托管协议的修改与终止 .....	97
<b>二十二、对基金份额持有人的服务 .....</b>	<b>98</b>
<b>二十三、其他应披露事项 .....</b>	<b>99</b>
<b>二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....</b>	<b>100</b>
<b>二十五、备查文件 .....</b>	<b>101</b>

## 一、绪 言

《易方达深证 100 交易型开放式指数基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金合同》（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。基金投资人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

本《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

本基金、基金：	指依据基金合同所募集的易方达深证 100 交易型开放式指数基金
基金合同：	指《易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金合同》及基金合同当事人对该合同不时作出的任何修订和补充
《托管协议》：	指《易方达深证 100 交易型开放式指数基金托管协议》及基金管理人、基金托管人对该协议不时作出的任何修订和补充
《基金法》：	指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》：	指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》：	指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《信息披露办法》：	指《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订
元：	指人民币元
交易型开放式指数基金：	指深圳证券交易所所有业务规则定义的“交易型开放式指数基金”
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
基金管理人：	指易方达基金管理有限公司
基金托管人：	指中国银行股份有限公司
注册登记机构：	指中国证券登记结算有限责任公司
登记结算机构：	指中国证券登记结算有限责任公司（简称“中国结算”）和易方达基金管理有限公司。其中：本基金认购份额的登记结算由中国结算负责办理；本基金份额在深圳证券交易所场内上市交易以及申购、赎回等相关业务的登记结算由中国结算负责办理；本基金的场外申购、赎回等相关业务的登记结算由易方达基金管理有限公司负责办理
登记结算业务：	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投



	资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
基金销售机构:	基金管理人、发售代理机构、办理本基金场外申购赎回业务的其他销售机构和办理场内申购赎回业务的申购赎回代理券商
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
代办证券公司:	指基金管理人指定的办理本基金场内申购、赎回业务的证券公司
基金销售网点	基金管理人的直销网点及其他基金销售机构的销售网点
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站
《更新的招募说明书》	基金合同生效后,基金管理人应按有关规定于每六个月结束之日起 45 日内编制并在指定媒体公告《更新的招募说明书》
基金合同当事人:	指受本基金合同约束,根据本基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者:	指依据中华人民共和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:	指依据中华人民共和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法人、社会团体、其它组织或投资主体
募集期:	指自基金份额开始发售之日起到基金份额发售结束之日止的时间段,最长不超过 3 个月
基金合同生效日:	指本基金达到法定的成立条件后,基金管理人按规定向中国证监会办理了验资和备案手续,得到中国证监会书面确认之日
存续期限:	指基金合同生效并存续的不定期之期限
工作日:	指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:	指本基金在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
认购:	指在本基金募集期内购买基金份额的行为,投资者可以现金或股票方式申请认购
申购:	指在基金存续期内,基金投资人按基金合同的约定申请购买基金份额的行为

赎回:	在本基金存续期内,基金投资人按基金合同的约定向基金管理人申请将其持有的本基金基金份额兑换为基金合同约定的赎回对价的行为
场外	不通过深圳证券交易所交易系统而通过销售机构自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额申购和赎回业务的场所
场内	通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易业务的场所
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,适用于场内份额的申购、赎回
申购对价:	在场内申购赎回方式下,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;在场外申购赎回方式下,申购对价指现金
赎回对价:	在场内申购赎回方式下,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;在场外申购赎回方式下,赎回对价指现金
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:	指深圳证券交易所编制并发布的深证 100 价格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
优化法	一种跟踪指数的方法。为达到复制指数的目的,根据一定的优化模型,通过选择部分成份证券并且/或者对成份证券权重进行优化配置,使指数组合的跟踪成本及跟踪误差控制在可以接受的范围之内
现金替代:	在场内申购赎回方式下,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:	在场内申购赎回方式下,指最小申购赎回单位的资产净值与按当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、申购或赎回的最小申

	购赎回单位数量计算
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,在场内申购赎回方式下,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计算依据及计算方法计算并发布的基金份额参考净值,简称 IOPV
预估现金差额:	在场内申购赎回方式下,是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,预估现金差额由代办证券公司预先冻结
基金份额折算与变更登记:	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折算与变更登记的行为
基金收益:	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金收益评价日:	指基金管理人计算本基金超过标的指数的超额收益率之日
基金资产总值:	指基金所购买各类证券价值、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值:	指基金资产总值减去负债后的价值
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收益的过程
基金份额净值:	指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
最小申购赎回单位净值	指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乘以最小申购赎回单位份额
基金份额持有人服务:	指基金管理人承诺为基金份额持有人提供的一系列服务

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人基本情况

1、基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-8 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

设立日期：2001 年 4 月 17 日

法定代表人：刘晓艳

联系电话：400 881 8088

联系人：贺晋

注册资本：12,000 万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4 号

经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

2、股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总计	100%

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，经济学硕士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理(主持工作)、国债部副总经理(主持工作)、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理(主持工作)；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限

公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁、董事。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理，广发控股（香港）有限公司董事，广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。

杨力先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事，盈峰资本管理有限公司总经理。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员，工商银行珠海分行法律顾问室办事员、营业部计划信贷部信贷员、办公室行长室秘书、信贷管理部业务主办、资产风险管理部经理助理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理，招商银行总行法律事务部行员，工商银行珠海分行资产风险部总经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、副行长、工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理，工商银行韶关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

刘韧先生，经济学硕士，董事。曾任湖南证券发行部经理助理，湘财证券投资银行总部总经理助理，财富证券投资银行总部副总经理，五矿二十三冶建设集团副总经理、党委委员。现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长，兼任佛山市国星光电股份有限公司董事，新晟期货有限公司董事，佛山电器照明股份有限公司董事，广晟有色金属股份有限公司董事。

朱征夫先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任，广东大陆律师事务所合伙人，广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师，美国加州高温橡胶公司市场部经理，美国加州大学讲师，美国南加州大学助理教授，香港科技大学副教授，中欧国际工商学院教授，瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师，中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司市场拓展部



总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李舫金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记，中国证监会广州证管办处长、广州市广永国有资产经营有限公司董事长、广州股权交易中心有限公司董事长、立根融资租赁有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理，万联证券有限责任公司董事长，广州银行副董事长，广州汽车集团股份有限公司独立董事，广州金控资本管理有限公司董事长，广州中盈（三明）基金管理有限公司董事长，广永期货有限公司董事，广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管，易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理，兼任广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益总部总经理；易方达资产管理有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、RQFII/QFII 产品投资决策委员会委员；中债资信评估有限责任公司独立董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产

品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、另类投资决策委员会委员。

## 2、基金经理小组介绍

王建军先生，经济学博士。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师、易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理助理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理（自 2010 年 9 月 27 日起任职）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2010 年 9 月 27 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2011 年 9 月 20 日起任职）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2011 年 9 月 20 日起任职）、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理（自 2012 年 9 月 20 日起任职）、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 3 日起任职）、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 3 日起任职）、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 3 日起任职）。

成曦先生，经济学硕士。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员。现任易方达基金管理有限公司易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理助理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理、易方达中小板指数分级证券投资基金基金经理助理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理助理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理助理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理助理。本基金历任基金经理情况：王守章先生，管理时间为 2006 年 3 月 24 日至 2006 年 4 月 7 日；马骏先生，管理时间为 2006 年 3 月 24 日至 2007 年 12 月 31 日；林飞先生，管理时间为 2006 年 7 月 4 日至 2015 年 6 月 5 日。

## 3、指数与量化投资决策委员会成员

本公司指数与量化投资决策委员会成员包括：林飞先生、罗山先生、张胜记先生。

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理，兼易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、证券交易负责人员（RO）、RQFII / QFII 产品投资决策委员会成员。

罗山先生，天体物理学博士。曾任巴克莱银行纽约分行衍生品交易部董事、新加坡分行信用产品交易部董事，苏格兰皇家银行香港分行权益及信用产品部总经理，加拿大皇家银行香港分行结构化产品部总经理，诚信资本合伙人，五矿证券公司副总裁，安信证券资产管理部副总经理，易方达基金管理有限公司指数及量化投资部资深基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数及量化投资部副总经理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理，兼易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

张胜记先生，管理学硕士。曾任易方达基金管理有限公司投资经理助理、基金经理助理、行业研究员、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原易方达沪深 300 指数证券投资基金）基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理助理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理，兼易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

#### 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金份额资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、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；
- 9、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 10、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 11、基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 12、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；
- 13、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。



## （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （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） 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- （4） 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5） 侵占、挪用基金财产；
- （6） 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7） 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8） 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、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，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （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，但是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，但标的指数成份股不受此限；
- （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。

### 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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- （3） 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，

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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作,有效地防范和化解经营风险,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,维护公司及公司股东的合法权益,本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

### 1、公司内部控制的总体目标

- (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性;
- (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯;
- (3) 实现公司稳健、持续发展,维护股东权益;
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守,正直诚信,廉洁自律,勤勉尽责;
- (5) 保护公司最重要的资本:公司声誉。

### 2、公司内部控制遵循的原则

(1) 全面性原则:内部控制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,并普遍适用于公司每一位职员;

(2) 审慎性原则:内部控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

(3) 相互制约原则:公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡;

(4) 独立性原则:公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位;公司内部部门和岗位的设置必须权责分明;

(5) 有效性原则:各种内部管理制度具有高度的权威性,应是所有员工严格遵守的行动指南;执行内部管理制度不能有任何例外,任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力;

(6) 适时性原则:内部控制应具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善;

(7) 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,力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面:第一个层面是公司章程;第二个层面是公司内部控制大纲,它是公司制定各项规章制度的基础和依据;第三个层面是公司基本管理制度;第四个

层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### 4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

##### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

##### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

##### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

##### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

##### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

##### (6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### (7) 监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察部开展监察稽核工作，并保证监察部的独立性和权威性。公司明确了监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动规范有效运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 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

中国银行客服电话：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、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，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 12 月 31 日，中国银行已托管 418 只证券投资基金，其中境内基金 390 只，QDII 基金 28 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、赎回代办证券公司（以下排序不分先后）

(1) 广发证券

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、41、42、43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(2) 安信证券

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

客户服务电话：4008001001

传真：0755-82558355

网址：www.essence.com.cn

(3) 渤海证券

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

客户服务电话：400-651-5988

传真：022-28451958

网址：www.bhzq.com

(4) 财通证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：夏吉慧

联系电话：0571—87925129

客户服务电话：95336（浙江）、40086-96336（全国）

网址：www.ctsec.com

(5) 长城证券

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

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：刘阳

联系电话：0755-83516289

客户服务电话：400-6666-888

传真：0755-83515567

网址：www.cgws.com

(6) 长江证券

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

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

联系电话：027-65799999

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(7) 德邦证券

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

联系电话：021-68761616

客户服务电话：400-8888-128

传真：021-68767880

网址：www.tebon.com.cn

(8) 第一创业证券

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼



办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

联系电话：0755-23838750

客户服务电话：4008881888

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

(9) 东方证券

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

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

传真：021-63326729

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

(10) 东海证券

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531；400-8888-588

传真：021-50498825

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

(11) 东吴证券

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客户服务电话：4008601555

传真：0512-65588021

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

(12) 东兴证券

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

办公地址：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：魏庆华

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

客户服务电话：400-8888-993

传真：010-66555133

网址：www.dxzq.net

(13) 方正证券

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：何其聪

联系人：徐锦福

联系电话：010-68546765

客户服务电话：95571

传真：010-68546792

网址：www.95571.cn

(14) 高华证券

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际中心 1801-1806、1826-1832 室

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际中心 1801-1806、1826-1832 室

法定代表人：章星

客户服务电话：400-888-1988

网址：www.ghsl.cn

(15) 光大证券

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

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

联系电话：021-22169999

客户服务电话：95525、400-8888-788、10108998

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(16) 广州证券

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

客户服务电话：020-961303

传真：020-88836654

网址：www.gzs.com.cn

(17) 国联证券

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

联系电话：0510-82831662

客户服务电话：95570

传真：0510-82830162

网址：www.glsc.com.cn

(18) 国泰君安证券

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

客户服务电话：95521 或 400-8888-666

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

(19) 国信证券

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

(20) 国元证券

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号国元大厦

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号国元大厦

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

开放式基金咨询电话：95578

开放式基金业务传真：0551-2272100

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

(21) 海通证券

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553

传真：021-23219100

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

(22) 华安证券

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318、400-80-96518（全国）

开放式基金业务传真：0551-65161672

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

(23) 华宝证券

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

联系电话：021-68778790

客户服务电话：400-820-9898

传真：021-68777992

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

(24) 华福证券

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18-19 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：郭相兴

联系电话：021-20655175

客户服务电话：0591-96326

传真：021-20655196

网址：www.hfzq.com.cn

(25) 华泰证券

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

网址：www.htsc.com.cn

(26) 华西证券

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：张曼

联系电话：010-52723273

传真：028-86150040

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

(27) 南京证券

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

联系人：孙秀玉

联系电话：025-83367888-4107

客户服务电话：400-828-5888

传真：025-83320066

网址：www.njzq.com.cn

(28) 平安证券

注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

联系电话：021-38637436

客户服务电话：95511-8

传真：021-58991896

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

(29) 山西证券

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：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

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

客户服务电话：95573 或 400-666-1618

传真：0351-8686619

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(30) 上海证券

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100，021-53686200

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(31) 申万宏源西部证券

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(32) 申万宏源证券

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

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

联系电话：021-33389888

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-33388224

网址：www.swhysc.com

(33) 信达证券

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

客户服务电话：400-800-8899

传真：010-63080978

网址：www.cindasc.com

(34) 兴业证券

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：柯延超

联系电话：0591-38507950

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(35) 银河证券

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

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-8888

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

(36) 招商证券

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：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

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565、400-8888-111

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

(37) 浙商证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7

法定代表人：吴承根

联系人：陆云

联系电话：021-64318677

客户服务电话：95345

传真：021-64713759

网址：www.stocke.com.cn

(38) 中航证券

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

联系电话：010-64818301

客户服务电话：400-8866-567

传真：0791-86770178

网址：www.avicsec.com

(39) 中泰证券

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮



联系人：马晓男

联系电话：021-20315255

客户服务电话：95538

传真：021-20315137

网址：www.qlzq.com.cn

(40) 中投证券

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82026907

客户服务电话：95532

网址：www.china-invs.cn

(41) 中信建投证券

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：95587

开放式基金业务传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(42) 中信证券

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：顾凌

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(43) 中信证券（山东）

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 20 层

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 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客户服务电话：95548

传真：0532-85022605

网址：www.citicssd.com

(44) 中银国际证券

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人：钱卫

联系人：王炜哲

开放式基金咨询电话：400-620-8888

开放式基金业务传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com

(45) 中原证券

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳 范春艳

联系电话：0371-69099882

联系传真：0371-65585899

客户服务电话：95377

网址：www.ccnew.com

## 2、二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

## 3、场外份额销售机构

直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-8 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

法定代表人：刘晓艳

电话：020-85102506

传真：4008818099

联系人：温海萍

网址：www.efunds.com.cn

直销机构网点信息：

(1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40 楼

电话：020-85102506

传真：400 881 8099

联系人：温海萍

(2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 1703 室

电话：010-63213377

传真：400 881 8099

联系人：刘蕾

(3) 易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市世纪大道 88 号金茂大厦 2706-2708 室

电话：021-50476668

传真：400 881 8099

联系人：于楠

## (二) 登记结算机构

### 1、场内份额登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：严峰

电话：(0755) 25946013

传真：(0755) 25987122

### 2、场外份额登记结算机构

名称：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-8 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

法定代表人：刘晓艳

成立时间：2001 年 4 月 17 日

客户服务电话：400 881 8088（免长途话费）

传真：(020) 38799249

联系人：余贤高

### （三）律师事务所和经办律师

律师事务所：北京金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人：王玲

电话：010-58785588

传真：010-58785599

经办律师：靳庆军、宋萍萍

联系人：王玲

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：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

首席合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈玲、沈兆杰

联系人：沈兆杰

## 六、基金份额折算、拆分、合并与变更登记

### （一）基金份额的折算

根据《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定 2006 年 4 月 14 日为本基金的基金份额折算日。当日深证 100 价格指数收盘值为 1119.210 点，基金资产净值为 5,480,979,078.98 元，折算前基金份额总额为 5,157,736,818 份，折算前基金份额净值为 1.063 元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.94948342，折算后基金份额总额为 4,897,166,634 份，折算后基金份额净值为 1.119 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 4 月 17 日进行了变更登记。折算后的基金份额计算到整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产）。

投资者可以于 2006 年 4 月 18 日起在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额。

### （二）基金份额的拆分

为了满足广大投资者的需求，提高本基金的流动性，优化持有人结构，本基金管理人于 2010 年 11 月 19 日对本基金实施了基金份额拆分。

经基金托管人复核，拆分前基金份额总额为 4,948,166,634 份，基金份额净值为 4.037 元。2010 年 11 月 19 日（拆分处理日），中国证券登记结算有限责任公司按拆分比例 5:1 对 2010 年 11 月 19 日（权益登记日）登记在册的本基金的基金份额实施拆分，并于 2010 年 11 月 19 日进行了变更登记。本基金拆分后，基金份额总额为 24,740,833,170 份，基金份额净值为 0.807 元；基金份额持有人原来持有的每 1 份基金份额变更为 5 份。

本基金已于 2010 年 11 月 22 日复牌，并于当日恢复日常申购、赎回业务。同时，本基金新增份额已在 2010 年 11 月 22 日上市流通并可赎回。本基金最小申购、赎回单位不作调整，即维持 100 万份。

本基金管理人已于 2010 年 11 月 20 日对本基金的拆分结果予以公告，投资者可以自 2010 年 11 月 22 日起通过申购赎回代办证券公司或二级市场交易代办证券公司查询拆分后其持有的基金份额。

### （三）基金份额的合并

为了满足广大投资者的需求，提高本基金的流动性，本基金管理人于 2014 年 8 月 29 日对本基金实施了基金份额合并。

本基金在 2014 年 8 月 29 日合并前基金份额总额为 17,827,833,170 份，基金份额净值为 0.5702 元。中国证券登记结算有限责任公司按合并比例 0.2:1 对 2014 年 8 月 29 日（权益登记日）登记在册的本基金的基金份额实施合并，并于 2014 年 8 月 29 日进行了变更登记。本基金合并后，2014 年 8 月 29 日基金份额总额为 3,565,567,465 份，基金份额净值为 2.8508 元；基金份额持有人原来持有的每 5 份基金份额变更为 1 份，合并产生的小数点后基金份额均进位为 1 份。

本基金已于 2014 年 9 月 1 日复牌，并于当日恢复日常申购、赎回业务。本基金最小申购、赎回单位由 100 万份调整为 20 万份。

本基金已于 2014 年 8 月 30 日对本基金的合并结果予以公告，投资者可以自 2014 年 9 月 1 日起通过申购赎回代办证券公司或二级市场交易代办证券公司查询合并后其持有的基金份额。

## 七、基金份额的交易

### （一）基金上市

本基金合同生效后，具备上市条件，于 2006 年 4 月 24 日开始在深圳证券交易所上市交易。（二级市场交易代码：159901）

### （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》等有关规定。

在具备相关条件的情况下，场外份额的基金份额持有人通过申请办理跨系统转托管，在将场外份额转为场内份额后，方可上市交易。

### （三）暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备《基金合同》第七部分第（一）款规定的上市条件；
- 2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

### （四）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的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定提前终止上市；
- 4、基金合同约定的终止上市的其他情形；
- 5、深圳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终止上市公告。

## （五）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、场内申购、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。



## 八、基金份额的申购、赎回

本基金的基金份额分为场内份额与场外份额两种，分别适用不同的申购赎回办法。

### （一）申购和赎回场所

#### 1、场内申购赎回

对于在场内申购赎回的投资人，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本基金的申购和赎回。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，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，予以公告。

#### 2、场外申购赎回

对于在场外申购赎回的投资人，应当在基金管理人或其指定的其他销售机构办理本基金的申购和赎回，基金管理人在开始场外申购、赎回业务前公告有关场外申购赎回的具体办法，包括但不限于：适用场外申购赎回方式的条件、开放日场外申购赎回的截止时间、业务规则等等。

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可根据市场情况停止办理场外申购赎回业务。在决定停止场外申购赎回业务情况下，基金管理人应采取适当措施对原有场外份额持有人作出妥善安排并提前公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者可办理场内基金份额申购、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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

投资者可办理场外基金份额的申购和赎回等业务的开放日为深圳证券交易所交易日，交易截止时间为开放日的 14:00，基金管理人可根据实际情况需要加以调整，具体办理时间以基金管理人的规定为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。本基金场外申购赎回的开放时间与场内申购赎回的开放时间可能存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。

场外投资者在开放时间以外提交的申购、赎回等交易申请，且登记结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

若深圳证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时

间进行相应的调整并公告。

## 2、申购、赎回的开始时间

本基金已于 2006 年 4 月 24 日开始办理场内申购赎回业务,已于 2015 年 5 月 21 日开始办理场外申购、赎回业务。。

### （三）场内申购和赎回的数额限制

1、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。

2、本基金最小申购赎回单位为 20 万份。基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整申购和赎回的数额限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

### （四）场外申购、赎回的数量限制

1、投资者每次申购的单笔最低金额为人民币 100 万元,每次赎回的单笔最低份额为 50 万份。

2、投资者可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回不得少于 50 万份(如该账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足 50 万份,则必须一次性赎回该基金全部场外份额);若某笔赎回将导致投资者在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足 50 万份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

3、上述规定详见基金管理人相关业务规则。基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （五）申购和赎回的原则

1、本基金的场内份额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;本基金的场外份额采用金额申购、份额赎回的方式,即申购以金额申请、赎回以份额申请;

2、本基金场内份额的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价;本基金场外份额的申购对价、赎回对价为现金;

3、场外份额申购赎回遵循“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

4、场外份额赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回;

5、场内申购、赎回申请提交后不得撤销;当日的场外申购、赎回申请可以在当日业务

办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

6、场内申购、赎回应遵守深圳证券交易所和登记结算机构的规定；场外申购赎回应遵守易方达基金管理有限公司的相关业务规则；

7、基金管理人可根据基金运作的实际情况，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下调整上述原则，或依据深圳证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整上述规则，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。

## （六）场内申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回申请的提出

投资者须按代办证券公司规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、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，必须持有足够的基金份额余额和现金。

### 2、申购和赎回申请的确认与通知

基金投资者申购、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确认情况。

### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金场内申购赎回过程中涉及的A股和ETF份额交收适用深圳证券市场最新的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后，登记结算机构在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、现金替代等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，并将结果发送给代办证券公司、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据登记结算机构的有关规定进行处理。

登记结算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指定媒体公告。

## （七）场外申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金管理人规定的程序，在开放日的开放时间内提出申购或赎回的申请。投资者在提交申购申请时须全额交付申购款项，并在规定的截止时间前划到销售机构指

定的账户上，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立而不予成交。

## 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人在场外申购、赎回开放日截止时间前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记结算机构在T+1日对该交易的有效性进行确认。申购、赎回的确认以基金登记结算机构的确认结果为准。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，投资人交付申购款项，申购成立；登记结算机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定的截止时间内未全额到账则申购不成立。若申购不成立或无效，基金管理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金管理人将在接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生场外巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

## 4、申购和赎回的注册登记

正常情况下，投资者T日申购基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资人自T+1日起有权申请赎回该部分基金份额，或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管；

基金份额持有人T日赎回基金成功后，正常情况下，登记结算机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续；

在法律法规允许的范围内，登记结算机构可以对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，基金管理人最迟于实施前在指定媒体上公告。

## 5、申购和赎回的投资交易

对于T日截止时间前收到的有效申购及有效赎回申请，基金管理人将根据轧差之后的净申购金额或净赎回数量，采用算法交易系统，按尽可能贴近收盘价的原则，在T日完成相应的证券交易。

# （八）场内申购和赎回的对价及费用

1、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。

2、投资者在申购或赎回基金份额时，代办证券公司可按照不高于 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3、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。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。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。

## （九）场外申购和赎回的价格及费用

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额计算结果均按四舍五入方法，保留到整数位，申购费用以人民币元为单位，四舍五入保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回相关费用（如有），赎回金额、赎回费用的单位为人民币元，四舍五入保留到小数点两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、投资者在申购或赎回基金份额时，基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平，收取一定的申购费和/或赎回费并归入基金资产，力争覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用。当前的申购、赎回费率如下：

申购费率：0.05%

赎回费率：0.15%

本基金的申购费由申购人承担，赎回费由赎回人承担，申购费与赎回费均全部归入基金财产。

5、申购份额、赎回金额的计算方式：

（1）申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其通用的计算方式为：

净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额÷T 日基金份额净值

（2）基金赎回金额的计算

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-赎回费用

6、由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。



## （十）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 日预估现金差额、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

组合证券是指本基金投资组合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组合证券名称、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。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

(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：可以现金替代的证券主要是因当天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 + 现金替代保证金率)

收取现金替代保证金的原因是，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保证金率，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保证金率，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。

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登记结算机构, 登记结算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), 登记结算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(MCR)的计算公式为:

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

说明: 假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

### (3) 必须现金替代

1) 适用情形: 必须现金替代的证券主要是因标的指数调整将被剔除、或基金管理人出于保护持有人利益原则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、预估现金差额相关内容

预估现金差额是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, 预估现金差额由代办证券公司预先冻结。

预估现金差额的计算公式为:

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 日经除权调整的前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：

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

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：

最新公告日期：	2016-03-24
基金名称：	深 100ETF
基金管理公司名称：	易方达基金管理有限公司
基金代码：	159901
标的指数代码：	399330

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）：	-13281.66
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）：	793747.34
基金份额净值（单位：元）：	3.9687

T 日信息内容

预估现金差额（单位：元）：	-10898.66
最小申购赎回单位（单位：份）：	200,000
T 日最小申购赎回单位分红金额（单位：元）：	无
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:	42%
当日累计申购份额上限:	无
当日累计赎回份额上限:	400000000

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量	现金替代标志	可以现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
000001	平安银行	2100	允许	15%			深圳市场
000002	万科A	1900	允许	15%			深圳市场
000009	中国宝安	400	允许	15%			深圳市场
000031	中粮地产	400	允许	15%			深圳市场
000039	中集集团	300	允许	15%			深圳市场
000046	泛海控股	400	允许	15%			深圳市场
000060	中金岭南	500	允许	15%			深圳市场
000061	农产品	400	允许	15%			深圳市场
000063	中兴通讯	800	允许	15%			深圳市场
000069	华侨城A	1100	允许	15%			深圳市场
000100	TCL 集团	2900	允许	15%			深圳市场
000157	中联重科	1500	允许	15%			深圳市场
000166	申万宏源	1100	允许	15%			深圳市场
000333	美的集团	700	允许	15%			深圳市场
000338	潍柴动力	800	允许	15%			深圳市场
000402	金融街	800	允许	15%			深圳市场
000413	东旭光电	700	允许	15%			深圳市场
000423	东阿阿胶	200	允许	15%			深圳市场
000425	徐工机械	1500	允许	15%			深圳市场
000503	海虹控股	200	允许	15%			深圳市场
000538	云南白药	100	允许	15%			深圳市场
000540	中天城投	800	允许	15%			深圳市场
000559	万向钱潮	400	允许	15%			深圳市场
000568	泸州老窖	200	允许	15%			深圳市场
000581	威孚高科	200	允许	15%			深圳市场

000598	兴蓉环境	600	允许	15%			深圳市场
000623	吉林敖东	200	允许	15%			深圳市场
000625	长安汽车	700	允许	15%			深圳市场
000629	攀钢钒钛	1300	允许	15%			深圳市场
000630	铜陵有色	2100	允许	15%			深圳市场
000651	格力电器		必须		28,830.00	28,830.00	深圳市场
000686	东北证券	400	允许	15%			深圳市场
000709	河钢股份	1500	允许	15%			深圳市场
000712	锦龙股份	200	允许	15%			深圳市场
000725	京东方 A	8000	允许	15%			深圳市场
000728	国元证券	400	允许	15%			深圳市场
000738	中航动控	100	允许	15%			深圳市场
000750	国海证券	500	允许	15%			深圳市场
000768	中航飞机	400	允许	15%			深圳市场
000776	广发证券	1000	允许	15%			深圳市场
000778	新兴铸管	700	允许	15%			深圳市场
000783	长江证券	1100	允许	15%			深圳市场
000792	盐湖股份	200	允许	15%			深圳市场
000793	华闻传媒	600	允许	15%			深圳市场
000800	一汽轿车	300	允许	15%			深圳市场
000825	太钢不锈	800	允许	15%			深圳市场
000826	启迪桑德	200	允许	15%			深圳市场
000831	五矿稀土	200	允许	15%			深圳市场
000839	中信国安	400	允许	15%			深圳市场
000858	五粮液	600	允许	15%			深圳市场
000876	新希望	300	允许	15%			深圳市场
000878	云南铜业	300	允许	15%			深圳市场
000883	湖北能源	600	允许	15%			深圳市场
000895	双汇发展	300	允许	15%			深圳市场
000917	电广传媒	400	允许	15%			深圳市场
000970	中科三环	300	允许	15%			深圳市场
000977	浪潮信息	200	允许	15%			深圳市场
001979	招商蛇口	700	允许	15%			深圳市场

002008	大族激光	300	允许	15%			深圳市场
002024	苏宁云商	1400	允许	15%			深圳市场
002030	达安基因	200	允许	15%			深圳市场
002065	东华软件	300	允许	15%			深圳市场
002081	金螳螂	300	允许	15%			深圳市场
002129	中环股份	500	允许	15%			深圳市场
002142	宁波银行	600	允许	15%			深圳市场
002146	荣盛发展	400	允许	15%			深圳市场
002202	金风科技	500	允许	15%			深圳市场
002230	科大讯飞		必须		8,379.00	8,379.00	深圳市场
002236	大华股份	200	允许	15%			深圳市场
002241	歌尔声学	300	允许	15%			深圳市场
002276	万马股份	200	允许	15%			深圳市场
002292	奥飞动漫	100	允许	15%			深圳市场
002304	洋河股份	200	允许	15%			深圳市场
002353	杰瑞股份	200	允许	15%			深圳市场
002385	大北农	400	允许	15%			深圳市场
002405	四维图新		必须		5,298.00	5,298.00	深圳市场
002415	海康威视	400	允许	15%			深圳市场
002450	康得新	400	允许	15%			深圳市场
002456	欧菲光	300	允许	15%			深圳市场
002465	海格通信	500	允许	15%			深圳市场
002475	立讯精密	200	允许	15%			深圳市场
002500	山西证券	400	允许	15%			深圳市场
002594	比亚迪	200	允许	15%			深圳市场
002673	西部证券	300	允许	15%			深圳市场
002736	国信证券	600	允许	15%			深圳市场
002739	万达院线		必须		8,030.00	8,030.00	深圳市场
300002	神州泰岳	300	允许	15%			深圳市场
300017	网宿科技	200	允许	15%			深圳市场
300024	机器人	200	允许	15%			深圳市场
300027	华谊兄弟	300	允许	15%			深圳市场
300058	蓝色光标	400	允许	15%			深圳市场

300059	东方财富	400	允许	15%			深圳市场
300070	碧水源	200	允许	15%			深圳市场
300104	乐视网	300	允许	15%			深圳市场
300124	汇川技术	200	允许	15%			深圳市场
300168	万达信息	200	允许	15%			深圳市场
300251	光线传媒	200	允许	15%			深圳市场
300253	卫宁健康	100	允许	15%			深圳市场
300315	掌趣科技	500	允许	15%			深圳市场
300498	温氏股份	100	允许	15%			深圳市场

说明：此表仅为示例。

### （十一）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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申请（基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内和场外两种申购方式，也可以只拒绝或暂停其中一种方式的申购）：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购；
- 2、深圳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、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4、深圳证券交易所、申购赎回代理证券公司、登记结算机构因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、深圳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；
- 5、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；
- 6、基金管理人认为接受某些申购申请将明显损害其他基金份额持有人的利益时；
- 7、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购上限，当一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申购超过申购赎回清单中规定的申购上限时，该笔申购申请将被拒绝；
- 8、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 9、法律法规、中国证监会或深圳证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第 6、7 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## （十二）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在如下情况下，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项（基金管理人可同时对场内和场外两种赎回方式实施暂停或延缓支付赎回款项，也可以只针对其中一种方式）：

- 1、不可抗力导致基金无法接受赎回；
- 2、深圳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、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4、深圳证券交易所、申购赎回代理证券公司、登记结算机构因异常情况无法办理赎回；
- 5、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时，可针对场外份额暂停赎回或延缓支付赎回款项；
- 6、场外份额连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- 7、法律法规、中国证监会或深圳证券交易所规定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应报中国证监会备案。发生场外巨额赎回的情形时，基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

## （十三）场外巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的场外基金份额净赎回申请（场外赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除场外申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现场外巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况对外场赎回决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部场外赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的场外赎回申请有困难或认为因支付投资人的场外赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受场外赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余场外赎回申请延期办理。对于当日的场外赎回申请，应当按单个账户场外赎回申请量占场外赎回

申请总量的比例，确定当日受理的场外赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交场外赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分场外赎回申请将被撤销。延期的场外赎回申请与下一开放日场外赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交场外赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上（含本数）发生场外巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的场外赎回申请；已经接受的场外赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述场外巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在三个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

## （十四）集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

## （十五）基金转换

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

## （十六）基金的转托管

本基金的转托管包括场外份额的系统内转托管及场内外份额的跨系统转托管。

条件许可情况下，在基金管理人制定并发布有关规则后，本基金场外份额可跨系统转托管为场内份额，并进行场内赎回、上市交易。但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

## 九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

登记结算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，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

### （二）投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股、参与新股市值配售、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下指数化投资比例不低于基金资产净值的 95%。

### （三）投资理念

指数化投资具有低成本、管理透明、多样化及分散化程度高等优点，能稳定地获得市场平均回报，有助于投资者实现与国民经济及股票市场同步增长的目标。标的指数具有良好的基本面、市场代表性和流动性，通过完全复制法实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，可以满足投资者多种投资需求。

### （四）投资策略

本基金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，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，以此构建本基金实际的投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

在法律法规许可时，基金管理人可运用股票期货、期权等相关金融衍生工具，以提高投资效率，更好达到本基金的投资目标。

基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的，不得将之应用于投机目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须按照公司制度提请审批。

#### 1、决策依据

- (1) 法律、法规和《基金合同》的规定；
- (2) 标的指数的编制方法及调整公告等；

(3) 对证券市场发展趋势的研究与判断。

## 2、投资决策流程

(1) 基金经理根据标的指数成份股名单及权重，进行投资组合构建；

(2) 当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整，以降低跟踪误差，实现对标的指数的紧密跟踪。

1) 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；

2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人根据指数成份股调整方案，判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。

3) 指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。

4) 法律法规限制、基金参与新股申购、股票长期停牌、股票流动性不足等情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响，据此对投资组合进行相应调整。

(3) 投资风险管理部定期对投资组合与业绩比较基准的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估；

(4) 基金经理参考有关研究报告及投资风险管理部的评估结果，适时调整投资组合。

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

## (五) 投资组合管理

为达到紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以全部或接近全部的基金资产，按照标的指数的权重比例分散投资于各成份股。正常情况下，本基金的股票投资不低于基金资产净值的 95%。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成分股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

正常情况下本基金将采用完全复制法，严格按标的指数的个股权重构建投资组合。但在少数特殊情况下基金经理将配合使用优化法作为完全复制法的补充，以更好达到复制指数的目标。基金经理采用优化法的情形包括：1) 由于标的指数成份股发生变动、增发/配股等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化，而由于交易成本、交易制度等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，需要采用优化方法保持组合对标的指数的拟合度并降低交易成本；2) 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量，需要采用优化方法选择能较好替代目标成份股的个股构建组合；3) 成份股派发现金股息而基金未进行收益分配可能导致基金组合与指数产生偏离；4) 相关上市公司停牌同时允许现金替代导致基金无

法及时买入成份股；5) 其它需要采用优化法的情形。

#### 1、投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

(1) 确定目标组合：基金管理人主要根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

(2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

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

(4) 如出于更好跟踪标的指数的目的需要投资于股票期权、期货等金融衍生工具的，基金经理应按照公司制度提交审议，说明进行上述投资的目的、投资价值金额、可能产生的风险以及相应控制措施等内容，经批准后方可进行。

#### 2、每日投资组合管理

(1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，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，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

(2) 标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

(3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

(5) 组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

(6) 以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购赎回清单并公告。

#### 3、定期投资组合管理

(1) 基金经理拟定资产配置计划，按照公司制度提交审议并实施。

(2) 根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### 4、投资绩效评估

(1) 投资风险管理部定期对本基金的运行情况进行评估。

(2) 基金经理根据评估结果分析投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成

份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## （六）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100价格指数。

如果指数编制单位变更或停止深证100 价格指数的编制及发布、或深证100价格指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证100价格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时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

## （七）风险收益特征

本基金属股票基金，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。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）禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是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，但标的指数成份股不受此限；
- 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、法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## （九）投资限制

依照《运作办法》，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

- 1、基金财产参与股票发行申购，单只基金所申报的金额超过基金总资产，单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 2、违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；
- 3、中国证监会规定禁止的其他情形。

## （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、不谋求对所投资公司的控股或者直接管理；
- 2、所有参与行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金资产的保值和增值。

## （十一）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## （十二）基金投资组合报告(未经审计)

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

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本投资组合报告。

本投资组合报告有关数据的期间为 2015 年 10 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 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	5,752,972,698.07	97.59
	其中：股票	5,752,972,698.07	97.59
2	固定收益投资	1,995,234.40	0.03
	其中：债券	1,995,234.40	0.03
	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	139,168,982.71	2.36
7	其他资产	1,185,924.77	0.02
8	合计	5,895,322,839.95	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 2 的合计项不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

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	25,243,906.00	0.43
B	采矿业	28,086,473.30	0.48
C	制造业	2,776,011,800.76	47.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,056,144.40	0.85
E	建筑业	33,046,769.32	0.56
F	批发和零售业	114,279,861.80	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	734,801,559.91	12.48
J	金融业	813,031,121.44	13.80
K	房地产业	713,383,152.32	12.11
L	租赁和商务服务业	83,252,158.98	1.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	160,989,791.97	2.73
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	173,857,764.59	2.95
S	综合	46,921,272.28	0.80
	合计	5,752,961,777.07	97.67

### 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



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	000002	万 科 A	18,370,305	448,786,551.15	7.62
2	000651	格力电器	9,266,801	207,113,002.35	3.52
3	000001	平安银行	12,839,545	153,946,144.55	2.61
4	000725	京东方 A	48,002,173	142,566,453.81	2.42
5	000333	美的集团	4,172,727	136,948,900.14	2.33
6	300104	乐视网	2,105,191	123,785,230.80	2.10
7	300059	东方财富	2,280,701	118,664,873.03	2.01
8	000776	广发证券	5,904,142	114,835,561.90	1.95
9	002024	苏宁云商	8,496,644	114,279,861.80	1.94
10	000858	五 粮 液	3,595,730	98,091,514.40	1.67

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,995,234.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,995,234.40	0.03

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	19,953	1,995,234.40	0.03

## 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 根据广发证券股份有限公司 2015 年 9 月 12 日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚事先告知书〉的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，被中国证监会予以警告及行政处罚。

在上述公告公布后，本基金管理人对广发证券进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对广发证券的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对广发证券的投资判断未发生改变。

除广发证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	527,672.93
2	应收证券清算款	633,103.62
3	应收股利	-
4	应收利息	25,148.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,185,924.77

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	---------	--------	--------



			公允价值（元）	值比例（%）	说明
1	000002	万 科 A	448,786,551.15	7.62	重大事项停牌
2	300104	乐视网	123,785,230.80	2.10	重大事项停牌

## 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2006年3月24日，基金合同生效以来（截至2015年12月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

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
基金合同生效至 2006年12月31日	85.53%	1.56%	92.96%	1.59%	-7.43%	-0.03%
2007年1月1日至 2007年12月31日	185.35%	2.38%	179.05%	2.40%	6.30%	-0.02%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-63.43%	3.04%	-63.57%	3.04%	0.14%	0.00%
2009年1月1日至 2009年12月31日	113.64%	2.15%	113.42%	2.15%	0.22%	0.00%
2010年1月1日至 2010年12月31日	-3.38%	1.72%	-4.28%	1.73%	0.90%	-0.01%
2011年1月1日至 2011年12月31日	-30.54%	1.41%	-30.99%	1.41%	0.45%	0.00%
2012年1月1日至 2012年12月31日	2.27%	1.44%	1.95%	1.46%	0.32%	-0.02%
2013年1月1日至 2013年12月31日	-3.15%	1.41%	-4.90%	1.42%	1.75%	-0.01%
2014年1月1日至 2014年12月31日	34.08%	1.20%	32.29%	1.21%	1.79%	-0.01%
2015年1月1日至 2015年12月31日	23.02%	2.58%	21.80%	2.59%	1.22%	-0.01%
基金合同生效至 2015年12月31日	353.56%	2.00%	332.13%	2.01%	21.43%	-0.01%

## 十二、基金的财产

### （一）基金财产构成

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和。基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （二）基金财产的帐户

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户，上述帐户与基金管理人、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。

### （三）基金财产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。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、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。非因基金财产本身承担的债务不得对基金财产强制执行。除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

## 十三、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

本基金的估值日为上海和深圳证券交易所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （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，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，以最近交易日的收盘价估值。

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，按最近交易日的收盘净价估值。

(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得到的净价进行估值, 估值日没有交易的, 按有交易的最近交易日所采用的净价估值。

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

(4) 在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, 采用估值技术进行估值。

(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, 按最近交易日的收盘价估值; 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; 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

4、其他资产按国家有关规定进行估值。

5、在任何情况下, 基金管理人采用上述 1-4 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。

6、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

## (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。基金份额净值由基金管理人完成估值后, 将估值结果以书面形式报给基金托管人, 基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核, 基金托管人复核无误后盖章返回给基金管理人, 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 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## （八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）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。

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 5 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。

## 十四、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、存款利息收入、买卖证券差价收入以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权。

2、基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，如基金收益评价日核定的基金超过同期标的指数的超额收益率达到1%以上，基金管理人可将净收益进行分配。

3、基金收益分配比例的确定原则：使收益分配后基金份额净值（如基金份额拆分或合并，则采用剔除拆分或合并因素的基金份额净值）尽可能贴近标的指数的千分之一。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基金份额净值低于面值。

4、自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配。

5、本基金场内及场外份额的收益分配均采用现金方式。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （三）基金收益分配数额的确定原则

1、计算基金收益评价日本基金超过标的指数的超额收益率

基金收益评价日本基金超过标的指数的超额收益率 = [基金收益评价日基金份额净值（如基金份额拆分或合并，则采用剔除拆分或合并因素的基金份额净值） - 基金收益评价日标的指数收盘价的千分之一] / 份额折算日基金份额净值 × 100%

剔除拆分或合并因素的基金份额净值 =

$$\frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额总额}} \times \prod_i \text{第}i\text{次基金份额拆分比例或合并比例}$$

注： $\prod_i$  为连乘符号。当基金份额拆分比例为 N 时，表示每一份基金份额拆分为 N 份；当

基金份额合并比例为 M 时，表示每 $\frac{1}{M}$ 份基金份额合并成 1 份。

当超额收益率超过1%时，基金管理人有权进行收益分配。

2、计算截至基金收益评价日本基金的净收益，并根据前述原则确定收益分配比例。

3、每基金份额的应分配收益为上述基金净收益乘以收益分配比例，计算基金收益分配金额，然后除以基金收益评价日发售在外的基金份额总额，保留小数点后3位，第4位舍去。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益分配金额、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

#### （五）收益分配的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定、基金托管人复核，按有关规定向中国证监会备案并公告。

#### （六）场外份额收益分配中发生的费用

场外份额收益分配时所发生的银行汇划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）与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金合同生效后的信息披露费用；
- （4）基金上市费及年费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；
- （7）证券交易费用；
- （8）基金收益分配中发生的费用；
- （9）按照法律法规和基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

#### 2、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

基金管理费按基金前一日资产净值乘以 0.5% 的管理费率来计算，具体计算方法如下：

**每日应计提的基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数**

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按该基金前一日资产净值乘以 0.1% 的托管费率来计算。计算方法如下：

**每日应计提的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数**

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

（3）上述 1. 基金费用的种类中（3）至（9）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

#### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损

失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### 4、基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和托管费，经中国证监会核准后公告。此项调整不需要召开基金份额持有人大会。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购、赎回费用

投资者在申购或赎回基金份额时，需按照本招募说明书第八章第(六)条的规定，交纳一定的申购、赎回佣金。

本基金申购、赎回均以份额申请，费用计算公式为：

申购/赎回佣金=申购/赎回份额×佣金比率

本基金申购、赎回佣金由代办证券公司在投资者申购、赎回确认时收取，用于市场推广费用、销售服务费用、证券交易所和登记结算机构收取的相关费用等。

## （三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，应按国家税收法律、法规履行其纳税义务。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，记帐单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建帐、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计帐目、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、具有证券相关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、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后 2 个工作日内公告。

## 十七、基金的信息披露

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将至少在一种指定媒体上公告。

### （一）基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当依据《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定公告基金合同和基金托管协议。

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同等有关规定编制并发布份额发售公告和招募说明书。

基金合同生效后，基金管理人应按有关规定于每六个月结束之日起四十五日内编制并在指定媒体公告《更新的招募说明书》。

### （二）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登载基金合同生效公告。

### （三）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并提前将基金份额折算日公告登载于指定媒体上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将基金份额折算结果公告登载于指定媒体上。

### （四）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的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。

### （五）基金份额净值公告、申购赎回清单及申购、赎回价格公告

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。基金管理人还将在每个开放日公告当日的申购赎回清单。

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媒体上。

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明场外基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。

## （六）定期报告

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等一系列有关证券投资基金信息披露的法律法规编制，包括年度报告、半年度报告、季度报告，并在指定媒体公告，同时报中国证监会备案。

年度报告：本基金的年度报告经注册会计师审计后在本基金会会计年度结束后的 90 日内公告。

半年度报告：本基金半年度报告在本基金会会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告。

季度报告：本基金季度报告每季度公告一次，于截止日后 15 个工作日内公告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## （七）临时报告与公告

本基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益及基金份额的交易价格产生重大影响的事项之一时，基金管理人、托管人必须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告。

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、提前终止基金合同；
- 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、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 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、变更、增加或减少基金销售机构；
- 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、赎回等业务和重新开放申购、赎回等业务；
- 24、基金其他业务的推出；
- 25、中国证监会规定的其他事项。

## （八）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、基金托管人和基金销售机构住所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。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，以及基金上市交易的证券交易所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证其所提供的文本与所公告文本的内容完全一致。

## 十八、风险揭示

### (一) 投资于本基金的主要风险

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

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

#### 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) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 对于场外份额的申购与赎回,基金管理人公布的申购费率、赎回费率与基金资产因投资人申购、赎回而受到的实际冲击可能存在差异,两者之间的差异由基金资产承担。因此,如果基金管理人对申购费率、赎回费率的估计结果同实际冲击程度差异较大,本基金也可能产生跟踪偏离风险。

(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

尽管可能性很小,但根据基金合同规定,如发生导致标的指数变更的情形,本基金管理人



可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更,本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化,且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

#### 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,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、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据基金管理人提供的计算依据及计算方法,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。

#### 7、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。

#### 8、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。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。

#### 9、投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时,如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,可能导致出现赎回失败的情形。

另外,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。

#### 10、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。

#### 11、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) 代办证券公司因多种原因,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理解偏差的风险。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、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。

#### 12、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、管理经验等因素可能影响基金收益水平。此外，相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因操作失误或违反操作规程等人为因素造成操作风险，例如申购赎回清单编制错误、交易错误等。

#### 13、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、登记结算机构及代销机构等。

#### 14、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、登记结算机构和代销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。

#### 15、本基金场内外份额申购赎回对价方式、业务规则等不同的风险

(1) 由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，与场内申购赎回所支付、取得的对价方式不同。

(2) 场外份额申购赎回交易截止时间为开放日的 14:00，并遵循“未知价”、“先进先出”等原则，与场内申购赎回的业务规则不同。

投资者需自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

#### 16、场外申购费率、赎回费率调整的风险

场外申购赎回业务的申购费率、赎回费率可能会根据市场交易佣金水平、印花税率等相关交易成本的变动而调整，场外份额投资人申购、赎回的成本可能受到影响。

#### 17、本基金场外份额暂不可上市交易的风险

本基金场外份额采取“金额申购、份额赎回”的方式，申购、赎回业务通过场外销售机构办理，由基金管理人办理基金份额的登记结算业务。目前场外份额、场内份额之间尚未开通跨系统转托管业务，因此场外份额暂不可转托管至场内，也不可上市交易。

## (二) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或

本金安全。

## 十九、基金合同的终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情形之一的，基金合同终止：

- 1、经基金份额持有人大会表决终止的；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、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；
- 4、法律法规和中国证监会规定的其他事由。

基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利时，可以留置基金财产或者对基金财产的权利归属人提出请求。

### （二）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

（1）自基金合同终止之日起30个工作日内成立清算小组，基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

（2）基金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。基金财产清算小组在成立后五个工作日内应当公告。

（3）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以基金的名义进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （5）公布基金财产清算公告；
- （6）对基金财产进行分配。

#### 3、清算费用

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

#### 4、基金财产清算剩余财产的分配

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)至(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人

#### 5、基金财产清算的公告

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

#### 6、基金财产清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、基金合同内容摘要

### （一）基金管理人的权利与义务

#### 1、基金管理人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，基金管理人根据基金合同的规定，独立运用并管理基金财产；

（2）根据基金合同的规定获得基金管理费；

（3）在符合有关法律法规、交易所及登记结算机构相关业务规则和基金合同的前提下，制订和调整基金业务规则，决定基金的相关费率结构和收费方式；

（4）根据基金合同规定销售基金份额，并收取基金认购费及其他法律法规规定的费用；

（5）从登记结算机构获取基金份额持有人名册；

（6）在基金存续期内，根据有关法律法规和基金合同的规定，决定拒绝和暂停受理基金份额的申购和赎回申请；

（7）依据基金合同的规定，制定基金收益的分配方案；

（8）依法召集基金份额持有人大会；

（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（10）依据基金合同及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律法规规定对基金财产或基金份额持有人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，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其他必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（11）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金代销机构的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金相关当事人的利益；

（12）按照法律法规或基金合同应由基金财产负担的因处理基金事务所支出的其他费用以及对第三人所负的债务，若基金管理人以其自有财产先行支付的，有从基金财产中受偿的权利；

（13）按照《基金法》、《运作办法》，代表基金份额持有人利益依法行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（14）在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资，并以相应基金财产履行偿还融资和支付利息的义务；

（15）本基金合同终止时，组建或参加清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(16) 法律、法规、本基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托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) 基金管理人将遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；自基金合同生效之日起，基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金财产；

(4) 设置相应的部门并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) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理上述业务；

(6) 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固有财产相互独立，确保分别管理、分别记账；保证本基金与基金管理人管理的其他基金之间在资产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别记账。

(7) 除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三方谋取不当利益，基金管理人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产，造成基金财产损失的，承担赔偿责任；

基金管理人不得将基金财产转为其自有财产，违背此款规定的，应承担相应的责任，包括但不限于恢复基金财产的原状、承担赔偿责任；

(8) 除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金财产；

(9) 接受基金托管人依据法律法规、本基金合同和《托管协议》对基金管理人履行本基金合同和托管协议的情况进行的监督；

(10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(11) 按规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格及申购、赎回的对价；

(12) 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股票、现金替代金额及现金差额；

(13) 严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金的商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等；除法律法规、基金



合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金管理人违反本基金合同规定的保密义务；

(15) 依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、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，并执行生效的基金份额持有人大会决议；

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

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

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

(19) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(20) 编制半年度和年度基金报告；

(21) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料15年以上；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方过错导致基金财产或基金份额持有人的利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(23) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会，通知基金托管人，并依法履行信息披露义务；

(24) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证基金投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(25) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

(26) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(27) 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；

(28) 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；

(29) 法律法规、本基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

### 1、基金托管人的权利

(1) 依法保管基金的资产；

- (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，如认为基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护相关当事人的利益；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (5) 依法召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (3) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (4) 除依据《基金法》、《运作办法》、《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不当利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格及申购、赎回对价；
- (6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全、完整和独立，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及其托管的其他基金财产相互独立，对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (7) 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；
- (8) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；
- (9) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；
- (11) 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购、赎回等事项符合法律法规及本基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金资产净值的方法符合法律法规及本基金合同等法律文件的规定；
- (13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资符合法律法规及本基金合同等法律文件的规定；
- (14) 依法履行信息披露义务，负责与基金托管业务活动有关的信息披露事项；按照法律法规的规定对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告等基金定期报告相关内容进行审

核,并出具基金托管人意见,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;

- (15) 按有关规定,保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上;
- (16) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (18) 依据基金管理人的指令或有关规定支付基金份额持有人的收益和赎回对价;
- (19) 参加基金清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会和中国银监会,通知基金管理人,并依法履行信息披露义务;
- (21) 因违反基金合同导致基金财产的损失,承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- (22) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,基金托管人应为基金向基金管理人追偿;
- (23) 依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会,并执行生效的基金份额持有人大会决议;
- (24) 按照法律法规规定和基金合同监督基金管理人的投资运作;
- (25) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动;
- (26) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者依据基金合同的规定取得本基金份额,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本基金合同的承认和接受。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1、基金份额持有人的权利

基金份额持有人有权按法律法规和本基金合同的规定:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配基金财产清算后的剩余财产;
- (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或者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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定履行其义务;
- (10) 法律法规和本基金合同规定的其他权利。

由于场内与场外申购、赎回方式上的差异,本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价,与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同;
- (2) 交纳基金认购、申购对价及规定的费用;
- (3) 在持有的基金份额范围内,承担基金财产亏损或者基金合同终止的有限责任;
- (4) 返还持有基金过程中获得的不当得利;
- (5) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
- (6) 法律法规和本基金合同规定的其他义务。

## (四) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成,基金份额持有人可委托代理人在授权范围内代表基金份额持有人行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额(包括场内份额和场外份额)拥有平等的投票权。

### 2、召开事由

- (1) 有以下事由情形之一的,应当召开基金份额持有人大会:
  - 1) 提前终止基金合同或变更基金合同,但本基金合同另有约定的除外;
  - 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;
  - 4) 更换基金托管人、基金管理人;
  - 5) 变更基金类别;
  - 6) 变更基金投资目标、范围或策略;
  - 7) 变更基金份额持有人大会程序;
  - 8) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - 9) 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)就涉及本基金的同一事项书面要求召开基

金份额持有人大会；

10) 提前终止基金上市，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；

11) 法律法规和本基金合同规定的其他情形。

(2) 需要决定下列事项之一时，不需召开基金份额持有人大会：

1) 调低基金管理费、基金托管费；

2) 在本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

3) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 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；

5) 在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，增设新的份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、调整场外申购赎回方式、开通跨系统转托管业务或暂停、停止场外申购赎回业务；

6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集

(1) 在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间及地点由基金管理人选择确定。

(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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(3) 代表基金份额 10%（含 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

代表基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集或均无法行使召集权的，代表基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金



份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### 4、基金份额持有人大会的通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日通过指定媒体公告会议通知。

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、表决方式；
- (3) 确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 其他注意事项。

如采用通讯方式开会并进行表决，会议通知应报中国证监会备案，且除上述内容外还要在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取的方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等。

#### 5、召开方式

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，具体由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人、转换基金运作方式和提前终止基金合同必须采取现场开会方式。

##### (1) 现场开会

1) 本基金合同所指现场开会系指由基金份额持有人本人出席或出具代理投票授权委托书委派其代理人出席参加基金份额持有人大会。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。

2) 基金份额持有人本人在出席基金份额持有人大会时，应向召集人出具符合法律法规、本基金合同及会议通知规定的有关证明文件。基金份额持有人的代理人在出席基金份额持有人大会时，除应向召集人提交上述证明文件外，还应提交有关基金份额持有人出具的有效书面授权委托书。

3) 现场开会须符合以下条件时，方可进行基金份额持有人大会议程：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，到会的基金份额持有人代表的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%。

##### (2) 通讯方式开会

1) 本基金合同所指通讯方式开会系指基金份额持有人或其授权投票的代理人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

2) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告。

3) 基金份额持有人本人在以书面通讯方式进行表决时, 应向召集人以书面方式提交符合法律法规和本基金合同及会议通知规定的有关证明文件。基金份额持有人的代理人在以书面通讯方式进行表决时, 应向召集人以书面方式提交有关基金份额持有人出具的有效书面授权委托书和基金份额持有人应当提交的上述有关证明文件。不能满足上述要求的基金份额持有人或基金份额持有人的代理人所提交的书面表决意见被视为无效, 其代表的基金份额不计入参加表决的总份额。

召集人在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; 在表决截止日以前实际送达召集人指定的地址的投票视为有效投票。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。

4) 以通讯方式开会须符合下列条件方视为有效: 本人直接或委托授权代表出具有效书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额总数的 50%。

### (3) 召集基金份额持有人大会的条件

基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上基金份额的持有人参加, 方可召开。

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

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容:

- 1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项;
- 2) 基金管理人、基金托管人、单独或合计持有本基金 10%以上(含 10%)基金总份额的基金份额持有人可以在基金份额持有人大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需审议表决的议案。
- 3) 基金份额持有人大会不得对未经事先公告的事项进行表决。

### (2) 议事程序

#### 1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经律师见证或公证员公证后形成大会决议。

基金份额持有人大会由基金管理人召集的, 大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表; 基金份额持有人大会由基金托管人召集的, 大会主持人为基金托管人授权出席会议的代



表；基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的，大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上（不含 50%）多数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。

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、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案；在通知载明的表决截止日期后第二天在公证机构监督下统计全部有效表决，形成决议。

## 7、表决

（1）基金份额持有人所持每一份基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权；

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议。

### 1) 一般决议

一般决议须经参加会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效。

除下列 2) 所规定的须以特别决议通过的事项以外的其他事项均应以一般决议的方式通过。法律法规另有规定时从其规定。

### 2) 特别决议

须经基金份额持有人大会通过的特别决议应当经参加会议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通过方为有效。涉及转换本基金运作方式、本基金合同的提前终止、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

（3）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（4）采取书面通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律、法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

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

## 8、计票

### （1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持

有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人。

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, 而出席会议的基金份额持有人或者代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议, 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。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人, 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。

### 9、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案, 基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内由相关信息披露义务人在至少一种指定媒体予以公告。

除非法律法规、本基金合同另有规定, 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、基金托管人均具有法律约束力, 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行。

## (五) 基金合同的变更和终止

### 1、基金合同的变更

(1) 本基金合同的变更涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的, 应当经基金份额持有人大会决议通过, 并经中国证监会备案。

(2) 但在下列情况下, 基金管理人和基金托管人协商后可直接变更基金合同, 无须召开基金份额持有人大会通过, 但应进行公告, 并报中国证监会备案:

1) 因法律、法规及中国证监会颁布之规定的相应修改而导致本基金合同的部分条款与之不符的, 则基金合同自行适用法律、法规及中国证监会颁布之规定的相应变更;

2) 因基金管理人、基金托管人的基本情况发生变更, 包括但不限于住所、法定代表人、组织形式、注册资本等情况的变更;

3) 不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化, 并不涉及基金份额持有人利益的基金合同的变更。

(3) 本基金合同规定基金管理人有权修改的事项, 一经公告, 即构成对基金合同的变更,

变更后的基金合同应报中国证监会备案。

(4) 在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，增设新的份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、调整场外申购赎回方式、开通跨系统转托管业务或暂停、停止场外申购赎回业务；

## 2、基金合同的终止

本基金出现下列情形之一的，本基金合同终止：

(1) 经基金份额持有人大会表决终止的；

(2) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

(3) 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；

(4) 法律法规和中国证监会规定的其他事由。

基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利时，可以留置基金财产或者对基金财产的权利归属人提出请求。

## (六) 争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本合同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首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，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根据提交仲裁时该会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、除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

## (七) 基金合同的存放及查阅方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的住所查阅；投资者也可在支付一定工本费后获得本基金合同复印件或复制件，但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（或简称“管理人”）

基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-8 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

法定代表人：刘晓艳

注册资本：12,000 万元人民币

经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

联系电话：400 881 8088

传真：020-38799488

#### 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

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

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。

企业类型：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

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，基金托管人应对基金管理人就基金资产的投资范围、投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金投资组合的监督和检查自基金合同生效三个月后开始。

（1）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（2）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，可以拒绝执行，并通知基金管理人，向中国证监会报告。

（3）基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。按照规定监督基金管理人的投资运作。

（4）如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

### 2、基金托管人对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否将基金财产和自有财产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（1）基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭



失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》《管理办法》、《基金合同》和有关其他法律法规的规定，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，基金管理人应报告中国证监会。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### (三) 基金财产保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规及规范性文件的规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管基金财产。

(2) 基金托管人应当设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据《基金法》、《管理办法》、本《基金合同》及其他有关法律法规及规范性文件的规定外，不为自己及任何第三人谋取不当利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于该基金财产；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，不得将其固有财产与基金财产进行交易，或将不同基金财产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任。

(5) 基金托管人必须将基金财产与自有财产严格分开, 将基金财产与其托管的其他基金财产严格分开; 基金托管人应当为本基金设立独立的账户, 建立独立的账簿, 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。

(6) 除依据《基金法》、《管理办法》、《基金合同》及其他有关法律法规、规范性文件的规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金财产;

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金财产; 非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、分配基金的任何资产。

(8) 对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人, 到账日基金资产没有到达托管人处的, 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。

(9) 对于基金申购、赎回过程中产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金资产没有到达托管人处的, 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。

## 2、基金合同生效时募集资产的验证和入账

(1) 基金募集期满或基金宣布停止募集时, 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, 并分别出具验资报告, 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) 验资完成, 基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中, 基金募集的股票存放在以基金名义开立的证券账户下, 基金托管人在收到资金和股票当日出具基金资产接收报告。

## 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、支付或收取现金差额、支付或收取现金替代款、支付或收取现金替代款的多退少补、支付基金收益, 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; 亦不得使用基金的任何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《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

## 4、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将本基金的证券账户出借和转让；亦不得使用本基金的任何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) 基金托管人应根据登记结算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。

(5) 因业务发展需要而开设的其他账户，可以根据法律法规、规范性文件和《基金合同》的规定，以及市场通行的习惯，由基金托管人负责开设。新账户按有关规则使用并管理。

(6) 在本托管协议订立日之后，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。

#### 5、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券以基金的名义由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 6、与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规的规定保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件。基金管理人在代表基金签署有关重大合同，后应及时将合同正本提交给基金托管人。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。

### (四) 基金资产的财务处理

#### 1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值的计算应该按照《基金合同》的规定进行。

(2) 基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规和其他规范性文件的规定。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、基金份额累计净值和还原后基金份额净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净

值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给相应的基金管理人；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净值的计算结果对外予以公布，基金托管人应该将相关情况报中国证监会备案。

## 2、基金账册的建账和对账

(1) 基金管理人和基金托管人在本基金《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) 双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

## 3、基金财务报表与报告的编制和复核

(1) 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 日内完成；更新的招募说明书在本基金《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十五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。

(2) 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立即进行复核，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 3 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。

(3) 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日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

(4) 基金合同生效后，如果相关法律、法规、规范性文件就基金财务报表与报告的编

制规则及编制内容颁布新的规定，基金管理人、基金托管人应依照届时有效的法律、法规、规范性文件的规定，互相配合、互相监督，进行编制和披露。

## （五）基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。

## （六）适用法律与争议解决

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，根据提交仲裁时该会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、除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。

## （七）托管协议的修改与终止

1、本协议经双方当事人盖章以及双方法定代表人或授权代表签字成立，自中国证监会批准基金募集之日起生效。本协议的有效期自生效日起至下款所述之情形发生时止。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- (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》、《管理办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、代办证券公司提供。投资者可通过以下方式了解基金产品与服务,进行各类业务咨询,或反馈投资过程中需要投诉与建议的情况,投资者如果认为自己不能准确理解本基金《招募说明书》、《基金合同》的具体内容,也可拨打以下电话详询:

客服热线: 4008818088 (免长途话费)

网址: <http://www.efunds.com.cn>

电子信箱: [service@efunds.com.cn](mailto:service@efunds.com.cn)

## 二十三、其他应披露事项

公告事项	披露日期
易方达基金管理有限公司关于设立大连分公司的公告	2015/11/4
关于易方达基金管理有限公司北京直销中心办公地址变更的公告	2015/12/18
易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金开放时间的公告	2015/12/31
易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	2016/1/4
易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金场内申赎等业务开放时间的公告	2016/1/5
易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	2016/1/7
易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	2016/1/28
易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门瑞尔特卫浴科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	2016/3/2
易方达基金管理有限公司关于增加恒泰证券为易方达深证 100 交易型开放式指数基金申购赎回代办证券公司的公告	2016/3/25

注：以上公告披露在中国证券报、上海证券报、证券时报上及基金管理人网站上。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

- 1、中国证监会批准易方达深证 100 交易型开放式指数基金募集的文件；
- 2、《易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金合同》；
- 3、《证券登记及服务协议》及附加协议；
- 4、《易方达深证 100 交易型开放式指数基金托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

2016 年 5 月 7 日