

**建信中证申万有色金属指数分级  
发起式证券投资基金  
招募说明书（更新）**

2016年第2号

**基金管理人：建信基金管理有限责任公司**

**基金托管人：国信证券股份有限公司**

二〇一六年九月

## 【重要提示】

本基金经 2015 年 6 月 4 日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1132 号文）注册，进行募集。本基金合同已于 2015 年 8 月 6 日生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券市场、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，敬请认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资基金的意愿、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：市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险（包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险）及其他风险，等等。

若因证券市场极端波动，本基金的基金财产在确认进行不定期份额折算后继续大幅下跌，导致本基金无法根据基金合同的约定，支付 A 类份额的约定收益，甚至无法支付 A 类份额的本金，在此情形下本基金 A 类份额可能发生本金风险。

本基金单笔场内认购/申购金额不得低于五万元。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 8 月 5 日，有关财务数据和净值表

现截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

一、绪言.....	5
二、释 义.....	6
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	24
六、基金份额的分级.....	29
七、基金份额的净值计算.....	30
八、基金的募集.....	33
九、基金合同的生效.....	40
十、基金份额的上市与交易.....	42
十一、基金份额的申购与赎回.....	44
十二、基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻.....	57
十三、基金份额的配对转换.....	59
十四、基金的投资.....	61
十五、基金的业绩.....	72
十六、基金的财产.....	73
十七、基金资产的估值.....	74
十八、基金的收益分配.....	79
十九、基金份额的折算.....	80
二十、基金的费用与税收.....	90
二十一、基金的会计与审计.....	93
二十二、基金的信息披露.....	94
二十三、风险揭示.....	100
二十四、基金的终止与清算.....	105
二十五、基金合同的内容摘要.....	107
二十六、基金托管协议的内容摘要.....	108
二十七、对基金份额持有人的服务.....	109
二十八、其他应披露事项.....	112
二十九、招募说明书的存放及查阅方式.....	114
三十、备查文件.....	115
附件一、基金合同的内容摘要.....	116

---

附件二、托管协议内容摘要 .....	139
--------------------	-----

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）等有关法律法规的规定，以及《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应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，并经中国证监会注册。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，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指国信证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《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，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
- 10、《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《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《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
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

会

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

16、个人投资者：指依据有关法律、法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、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

19、投资人：指个人投资者、机构投资者和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人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人，按其持有的基金份额不同，可区分为建信有色份额持有人、建信有色 A 份额持有人及建信有色 B 份额持有人

21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

22、销售机构：指建信基金管理有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，代为办理基金销售业务的机构

23、场外：通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

24、场内：通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回



25、**登记业务**：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括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

26、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为建信基金管理有限责任公司或接受建信基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

27、**注册登记系统**：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，登记在该系统的基金份额也称为场外份额

28、**证券登记结算系统**：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，登记在该系统的基金份额也称为场内份额

29、**基金账户**：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

30、**基金交易账户**：指销售机构为投资人开立的、记录投资人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变动及结余情况的账户

31、**标的指数**：指中证申万有色金属指数

32、**基金份额**：指建信有色份额、建信有色 A 份额和/或建信有色 B 份额

33、**建信有色份额**：指建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之基础份额

34、**建信有色 A 份额**：指建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之 A 份额，即低风险且预期收益相对较低的稳健收益类份额

35、**建信有色 B 份额**：指建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之 B 份额，即高风险且预期收益相对较高的积极收益类份额

36、**基金合同生效日**：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

37、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

38、**基金募集期**：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最

长不得超过 3 个月

39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

41、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

43、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

45、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

46、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

47、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

48、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，建信有色份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额）的 10%

50、配对转换：指建信有色份额与建信有色 A 份额、建信有色 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并

51、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的建信有色份额按照 2 份场内建信有色份额对应 1 份建信有色 A 份额与 1 份建信有色 B 份额的比例进行转换的行为

52、合并：指基金份额持有人将其持有的建信有色 A 份额与建信有色 B 份额按照 1 份建信有色 A 份额与 1 份建信有色 B 份额对应 2 份场内建信有色份额的比例进行转换的行为

53、折算：指在基金份额持有人所持基金资产净值不变的前提下，由基金管理人按照一定比例调整建信有色份额净值、建信有色 A 份额参考净值和/或建

信有色 B 份额参考净值，使得基金份额持有人所持基金份额相应变化的行为，包括定期折算和不定期折算

54、定期折算：指基金管理人按一定的周期进行的基金份额折算的行为

55、不定期折算：指当建信有色份额净值、建信有色 A 份额参考净值和/或建信有色 B 份额参考净值满足一定的条件时，基金管理人进行的基金份额折算行为

56、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

57、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管

58、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

59、跨系统转托管：指投资者将持有的建信有色份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

60、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

61、元：指人民币元

62、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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

63、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

64、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

65、基金份额净值：指每一份基金份额所代表的基金资产净值，按基金份额的不同，可区分为建信有色份额净值、建信有色 A 份额净值、建信有色 B 份额净值

66、**基金份额参考净值**：指在基金份额净值计算的基础上，根据《基金合同》给定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为建信有色 A 份额参考净值、建信有色 B 份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

67、**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

68、**定期折算期间**：第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日

69、**指定媒介**：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

70、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

71、**发起资金**：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外公司投研人员）等人员的资金

72、**发起资金提供方**：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外公司投研人员）等人员

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

成立日期：2005年9月19日

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由6名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

许会斌先生，董事长。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。自2011年3月至2015年3月出任中国建设银行批发业务总监；自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长；自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理。许先生是高级经济师，并是国务院特殊津贴获得者，曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。

1983年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。

孙志晨先生，董事。现任建信基金管理有限责任公司总裁，兼建信资本管理公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院，1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理，博时基金管理有限公司副总经理，新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获 Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

## 2、监事会成员

王雪玲女士，监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业，高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员；中国建设银行新疆区分行计划处、信贷处、风险处和人力部等副处长、处长、行长助理、副行长；中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公

司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团财务有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

吴灵玲女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总经理兼综合管理部总经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系，获得学士学位；2001年毕业于北京师范大学经济系，获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员，高级经理助理，建信基金管理公司人力资源管理部总监助理，副总监，总监。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业，获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技部科员、中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总监助理、副总监；信息技术部副总监、总监。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

### 3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张威威先生，副总裁。1997年毕业于大连理工大学，获学士学位；2003年毕业于大连理工大学，获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行筹资处科员、主任科员；中国建设银行总行个人银行业务部主任科员、高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副总裁。

曲寅军先生，副总裁。1996年毕业于中国人民大学，获学士学位；1999年毕业于中国人民大学，获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员、副主



任科员；团委主任科员；重组改制办公室高级副经理；行长办公室高级副经理。2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月至今，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理，并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副总裁。

#### 4、督察长

吴曙明先生，督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系，获学士学位；1999年毕业于财政部财政科学研究所，获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行总行，先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，曾任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职。2006年3月加入建信基金管理公司，担任董事会秘书兼综合管理部总监。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

#### 5、本基金基金经理

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA），2003年1月获清华大学经济学博士学位。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、权益投资部总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理；2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理；2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理；2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理；2015年8月6日起任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

李菁，固定收益投资部总经理。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

姚锦女士，权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。

顾中汉先生，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部副总经理。

**7、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和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

### **（四）基金管理人承诺**

- 1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；
- 2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

- (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) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、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、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。
- (2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。
- (3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。
- (4) 有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对其工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。
- (5) 防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。
- (6) 适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，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。

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立了审计与风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### (2) 风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

### (3) 操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

#### （4）信息与沟通

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

#### （5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的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：国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”）

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

成立时间：1994 年 6 月

组织形式：股份有限公司

注册资本：82 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]1666 号

联系人：姚铮

联系电话：0755-22940063

国信证券股份有限公司（简称“国信证券”）源起于中国证券市场最早的三家营业部之一深圳国投证券业务部，1994 年成立公司。国信证券是全国性大型综合类证券公司，法定代表人为何如，注册资本 82 亿元，总部设在深圳，截至 2016 年 6 月 30 日，公司共设有 51 家分公司、166 家证券营业部，分布于全国 119 个中心城市和地区。，同时拥有三家全资子公司：国信期货有限责任公司、国信弘盛创业投资有限公司、国信证券（香港）金融控股有限公司，并参股鹏华基金管理有限公司、前海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心、青岛蓝海股权交易中心。公司拥有齐全的证券业务牌照，经营范围涵盖：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管业务。国信的企业精神是“务实、专业、和谐、自律”，核心理念是“创造价值，成就你我”。截至 2015 年 12 月 31 日，公司总资产 2443.53 亿元，净资产 498.73 亿元，净资本 478.39 亿元。2015 年，公司实现营业收入 291.39 亿元、净利润 139.49 亿元。

2016年1-6月，公司实现净利润25.55亿元。

## （二）主要人员情况

国信证券托管部管理团队和业务骨干具有十年以上银行、财务、证券清算等金融和证券从业经验，可为客户提供更多安全高效的增值服务。同时，托管部50%的员工具有IT专业背景，可为托管客户提供个性化产品处理能力；骨干员工从国信证券运营部门抽调，具备各类创新产品的核算、估值处理能力。

## （三）基金托管业务经营情况

国信证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。国信证券托管部本着“为您理去繁杂，专注价值”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

## （四）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

国信证券作为基金托管人：

（1）托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

（3）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

（4）不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

### 2、内部控制组织结构

公司针对资产托管业务建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持资产托管业务的内部控制制度健全、执行有效。

公司监察稽核总部、风险监管总部、合规管理总部将根据法律法规和公司相关制度，定期或不定期对开展该业务的相关部门进行稽核检查，评估风险控制措施的有效性，对发现的问题，要求相关部门及时整改，并对整改情况进行

监督。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

国信证券托管部制定投资监督标准与监督流程，依据法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，在授权范围内独立履行对托管资产投资运作的监督职责。

投资监督可以为事中监督和事后监督，主要内容包括：（一）对托管资产的投资范围、投资比例、投资限制进行监督；（二）对托管资产的核算估值是否符合相关法律法规和规范性文件、基金合同和托管协议的约定进行监督；

（三）对托管资产的资金运用、计提和支付各类费用等情况进行监督；（四）对托管资产是否存在透支行为、应收款项是否及时足额到账进行监督；（五）对托管资产的收益分配是否符合法律法规和托管协议的约定进行监督；（六）其他法律法规、基金合同和托管协议约定的监督事项。

公司在对托管资产的投资运作监督过程中，发现违反法律、行政法规和其他相关规定，或者违反基金合同和托管协议约定的事项，应当履行通知管理人、报告监管部门等程序，并持续跟进管理人的后续处理，督促管理人依法履行信息披露义务。



## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 场外发售机构

##### （1）直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

##### 1) 直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

##### 2) 网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

##### （2）代销机构

###### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### （2）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555（或拨打各城市营业网点咨询电话）

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

(3) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪琦

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(4) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

(5) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(6) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(7) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

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

(8) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话: 4001818188

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(9) 和讯信息科技有限公司

注册地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

客户服务电话: 4009200022

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

(10) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人: 凌顺平

客户服务电话: 400-877-3772

网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(11) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人: 蒋煜

客户服务电话: 4008188866

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

(12) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人: 梁越

客户服务电话: 4007868868

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

(13) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室

法定代表人: 张晶

客户服务电话: 400-820-2819

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

(14) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com/](http://www.noah-fund.com/)

(15) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

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

(16) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

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

(17) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

网址：[www.jinqianwo.cn/](http://www.jinqianwo.cn/)

(18) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

(19) 上海利得基金销售有限公司

地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

客户服务热线：400-033-7933

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

(20) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客户服务热线：010-56282140

网址：www.fundzoe.cn

(21) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

客户服务热线：4000-466-788

(22) 深圳前海微众银行股份有限公司

地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心 A36 楼

法定代表人：顾敏

客户服务热线：400-999-8800

网址：www.webank.com

(23) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务热线：400-684-0500

网址：https://www.ifastps.com.cn

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

## 2、场内发售机构

(1) 本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售资格的深交所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

### (二) 基金登记结算机构

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 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：刘焕志

电话：010—52682888

传真：010—52682999

经办律师：刘焕志、孙艳利

### （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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

## 六、基金份额的分级

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括建信有色份额、建信有色A份额、建信有色B份额。根据对基金财产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。

建信有色A份额与建信有色B份额的配比始终保持1：1的比率不变。

### （二）基金份额分级规则

#### 1、基金份额的发售

本基金通过场外和场内两种方式公开发售。基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为建信有色份额；场内认购的份额将按照1：1的比例确认为建信有色A份额与建信有色B份额。

#### 2、基金份额的申购赎回

基金合同生效后，建信有色份额接受场外、场内申购和赎回，但不上市交易建信有色A份额与建信有色B份额不接受单独申购、赎回，只能进行上市交易。

#### 3、基金份额的配对转换

基金合同生效后，建信有色份额与建信有色A份额、建信有色B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的建信有色份额按照2份场内建信有色份额对应1份建信有色A份额与1份建信有色B份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的建信有色A份额与建信有色B份额按照1份建信有色A份额与1份建信有色B份额对应2份场内建信有色份额的比例进行转换的行为。

场内份额的配对转换遵循深圳证券交易所、基金登记机构的最新业务规则。场外份额通过跨系统转托管至场内后，方可按照上述规则进行基金份额配对转换。

## 七、基金份额的净值计算

### （一）基金份额的净值计算规则

根据对基金财产和收益分配的不同安排，建信有色份额、建信有色A份额、建信有色B份额具有不同的风险收益特性，体现为不同的净值计算规则。

1、建信有色份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为建信有色份额、建信有色A份额、建信有色B份额的份额数之和。

2、建信有色A份额的基金份额净值为建信有色A份额的本金及约定应得收益之和。建信有色A份额的约定应得收益依据建信有色A份额的约定年基准收益率和截至净值计算日建信有色A份额应计收益的天数占当年实际天数的比例确定。

基金合同生效日至第一次份额折算基准日前一日，建信有色A份额的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+4.5%”；第一次份额折算基准日后，建信有色A份额的约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.5%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以最近一次份额折算基准日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。年基准收益均以1.00元为基准进行计算。

建信有色A份额的份额净值在净值计算日应计收益的天数按基金合同生效日至净值计算日或自最近一次基金份额折算日（定期折算日或不定期折算日）至净值计算日的实际天数累加计算。

3、每2份建信有色份额所对应的基金资产净值等于1份建信有色A份额与1份建信有色B份额所对应的基金资产净值之和。

基金管理人并不承诺或保证建信有色A份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现损失情况下，建信有色A份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

### （二）基金份额净值、基金份额参考净值的计算

基金管理人按照基金份额的净值计算规则依据以下公式在各自的基金份额净值计算日分别计算并公告建信有色份额的基金份额净值、建信有色A份额与



建信有色 B 份额的基金份额参考净值。

### 1、建信有色份额的基金份额净值计算

设 T 日为建信有色份额的基金份额净值计算日，则建信有色份额的基金份额净值为：

$$NAV_{\text{建信有色份额}} = \frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额总数}}$$

其中，基金资产净值是指 T 日收市后基金资产总值减去负债后的价值，基金份额总数为 T 日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的份额数之和。

建信有色份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的建信有色份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 2、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金份额净值计算的基础上计算建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值。基金份额参考净值是对相应基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。 设 T 日为建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值计算日，则建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值为：

$$NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考}} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考}} = 2 \times NAV_{\text{建信有色份额}} - NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考}}$$

其中，N 为定期折算期间的实际天数； $t = \min\{\text{自基金合同生效日至 T 日，自最近一次基金份额折算日至 T 日}\}$ ； $NAV_{\text{建信有色份额}}$  为 T 日建信有色份额净值； $NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考}}$  为 T 日建信有色 A 份额参考净值； $NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考}}$  为 T 日建信有色 B 份额参考净值；R 为建信有色 A 份额的约定年基准收益率。

建信有色 A 份额参考净值与建信有色 B 份额参考净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

T 日的建信有色 A 份额参考净值与建信有色 B 份额参考净值在当天收市后计

算，并在T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 八、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会2015年6月4日证监许可[2015]1132号文注册。除法律、行政法规或中国证监会另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留或提前发售基金份额。

具体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准，请投资人就发售和购买事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

### （一）基金运作方式和类型

契约型开放式，股票型证券投资基金

本基金为发起式基金。发起式基金是指，基金管理人在募集基金时，使用公司股东资金、公司固有资金、公司高级管理人员或者基金经理等人员资金认购基金的金额不少于一千万元人民币，且持有期限不少于三年。发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。

### （二）基金的存续期间

不定期

基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同应当终止。《基金合同》生效三年后继续存续的，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金合同应当终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。

### （三）上市交易所

深圳证券交易所

### （四）募集对象

个人投资者、机构投资者及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。

### （五）募集方式

本基金通过场外和场内两种方式公开发售。

基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为建信有色份额，并登记在注册登记系统基金份额持有人深圳开放式基金账户下；场内认购的份额将按照1：1的比例确认为建信有色A份额与建信有色B份额，并登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

## （六）募集期限

自基金份额发售之日起不超过3个月，具体发售时间见发售公告。

## （七）募集目标

本基金的最低募集金额为1000 万元，不设募集上限。

## （八）基金份额的场外认购

### 1、募集场所

本基金的场外认购将通过基金管理人的直销网点及基金其他销售机构的销售网点进行，其他销售机构的具体名单请参见基金份额发售公告。

销售机构办理本基金场外认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

### 2、基金的面值、认购价格、认购费用

#### （1）基金的面值和认购价格

本基金份额发售面值为人民币1.00元，场外认购价格为发售面值。

#### （2）认购费用

本基金的场外认购费率最高不超过0.40%，且随投资者认购金额的增加而减少。投资者可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

本基金场外认购费率如下表：

认购金额（元）	认购费率
M < 50 万	0.40%
M ≥ 50 万	每笔 100 元

基金认购费用由投资者承担，在认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

### （3）其他收费模式

本基金的场外认购目前仅开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式，也可能相应增加新的基金份额类别，并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。增加新的收费模式，应当按照当时法律法规、监管机构的规定，履行适当的程序并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告。

### 3、认购份额的计算

基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额，计算公式如下：

（1）当认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法为：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；

经确认的建信有色份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值。

（2）当认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法为：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

经确认的建信有色份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值。

场外认购份额和利息折算的份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者在场外认购本基金100,000元，所对应的认购费率为0.4%。假定该笔认购金额产生利息20.00元。则认购份额为：

净认购金额 = 100,000 / (1 + 0.4%) = 99,601.59元；

认购费用 = 100,000 - 99,601.59 = 398.41元；

经确认的建信有色份额 = (99,601.59 + 20.00) / 1.00 = 99,621.59份。

即，若该投资者在场外认购本基金100,000元，在《基金合同》生效时，投资者账户登记有本基金建信有色份额99,621.59份。

### 4、投资者对基金份额的认购

(1) 认购时间安排 投资者可在募集期内前往本基金的销售网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见基金份额发售公告或各其他销售机构相关业务办理规则。

#### (2) 投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者办理场外认购时，需具有中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。其中：已通过场外销售机构办理过开放式基金账户注册或注册确认手续的投资者，可直接办理本基金场外认购业务；已有深圳证券账户的投资者，可通过场外销售机构以其深圳证券账户申请注册开放式基金账户；尚无深圳证券账户的投资者，可直接申请账户开户，中国证券登记结算有限责任公司将为其配发深圳证券投资基金账户，同时将该账户注册为开放式基金账户。

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见基金份额发售公告或各其他销售机构相关业务办理规则。

#### (3) 认购的方式及确认

1) 本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资者认购前，需按销售机构规定的方式备足认购的款项。

2) 基金募集期内，投资者可多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3) 投资者在T日规定时间内提交的认购申请，通常应在T+2日到原销售网点查询认购申请的受理情况。

4) 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者可及时查询并妥善行使合法权利。

#### (4) 认购的限额

对于场外认购，本基金销售网点每个基金账户单笔最低认购金额为10元，如果其他销售机构业务规则规定的最低单笔认购金额高于10元，以其他销售机构的规定为准。直销机构的首次最低认购金额为10元，追加认购单笔最低认购金额为10元。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限

制。

## （九）基金份额的场内认购

### 1、募集场所

本基金的场内认购将通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位营业部进行，会员单位的具体名单请参见深圳证券交易所网站。

销售机构办理本基金场内认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方法，请参见各销售机构公告或网站。

### 2、基金的面值、挂牌价格、认购费用

#### （1）基金的面值和认购价格

本基金份额发售面值为人民币1.00元，场内挂牌价格为发售面值。

#### （2）认购费用

本基金的场内认购费率由深圳证券交易所会员单位按照场外认购费率设定。投资者可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

基金认购费用由投资者承担，在认购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

### 3、认购份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额；

认购费用 = 净认购金额 × 认购费率；

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用；

利息折算的份额 = 认购利息 / 挂牌价格；

经确认的建信有色A份额 = (认购份额 + 利息折算的份额) × 0.5；

经确认的建信有色B份额 = (认购份额 + 利息折算的份额) × 0.5。

场内认购份额和利息折算的份额计算结果保留到整数位，小数部分舍弃，余额计入基金财产。

例：某投资者在场内认购本基金100,000份，所对应的认购费率为0.4%。假定该笔认购金额产生利息20元。则认购份额为：

净认购金额 =  $1.00 \times 100,000 = 100,000$ 元；

认购费用 =  $100,000 \times 0.4\% = 400$ 元；

认购金额 =  $100,000 + 400 = 100,400$ 元；

利息折算的份额 =  $20 / 1.00 = 20$ 份；

经确认的建信有色A份额 =  $(100,000 + 20) \times 0.5 = 50,010$ 份；

经确认的建信有色B份额 =  $(100,000 + 20) \times 0.5 = 50,010$ 份。

即，若该投资者在场内认购本基金100,000份，需要缴纳认购金额100,400元，在《基金合同》生效时，投资者账户登记有本基金建信有色A份额50,010份、建信有色B份额50,010份。

#### 4、投资者对基金份额的认购

##### (1) 认购时间安排

投资者可在募集期内前往本基金的销售网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见基金份额发售公告或各其他销售机构相关业务办理规则。

##### (2) 投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者办理场内认购时，需具有深圳人民币普通股票账户或证券投资基金账户（以下简称“深圳证券账户”）。已有深圳证券账户的投资者可直接认购上市开放式基金。尚无深圳证券账户的投资者可通过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构开立账户。

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见基金份额发售公告或各其他销售机构相关业务办理规则。

##### (3) 认购的方式及确认

1) 本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资者认购前，需按销售机构规定的方式备足认购的款项。

2) 基金募集期内，投资者可多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3) 投资者在T日规定时间内提交的认购申请，通常应在T+2日到原销售网点查询认购申请的受理情况。

4) 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机



构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者可及时查询并妥善行使合法权利。

#### （4）认购的限额

对于场内认购，深圳证券交易所会员单位每笔最低认购份额为50,000份，超过50,000份的应为1,000份的整数倍，且每笔认购最大不超过99,999,000份。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

### （十）募集期利息的处理方式

《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。

### （十一）募集结果

截止2015年7月31日，本基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集有效认购户数为1,620户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，设立募集期募集及利息结转的基金份额共计248,987,307.28份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 九、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元，发起资金的提供方承诺持有期限不少于三年的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在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，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 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款项，并加计银行同期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

《基金合同》生效三年后继续存续的，连续二十个工作日出现基金份额持

有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金合同应当终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 十、基金份额的上市与交易

《基金合同》生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，建信有色A份额与建信有色B份额分别在深圳证券交易所上市与交易。建信有色A份额与建信有色B份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。本部分中，如无特别说明，本基金或基金份额特指建信有色A份额与建信有色B份额。

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （二）上市交易的时间

《基金合同》生效后三个月内，本基金开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在至少一家指定媒介刊登基金份额上市交易公告书。

### （三）上市交易的规则

- 1、建信有色A份额与建信有色B份额分别采用不同的交易代码上市交易；
- 2、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额参考净值；
- 3、本基金上市交易的其他规则遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示本基金前一交易日的基金份额参考净值。

### （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

### （七）其他事项

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 十一、基金份额的申购与赎回

《基金合同》生效后，建信有色份额接受投资者的场外、场内申购与赎回。场外认购或申购的建信有色份额登记在注册登记系统基金份额持有人深圳开放式基金账户下；场内认购或申购的建信有色份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

本章中，如无特别说明，本基金或基金份额特指建信有色份额，基金份额净值特指建信有色份额净值。

### （一）基金份额的场外申购与赎回

#### 1、申购和赎回场所

投资者办理本基金场外申购、赎回业务的场所为基金管理人的直销网点和基金管理人委托的其他销售机构的销售网点。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

#### 2、申购和赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2日在至少一家指定媒介及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间见基金管理人届时发布的相关公告。

基金管理人不得在《基金合同》约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在《基金合同》约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，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。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日2日前在指定媒介公告。

### 3、申购和赎回的原则

(1) “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；

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

(3) 场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购、跨系统转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；

(4) 当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，场内申购与赎回申请可以在深圳证券交易所规定的时间以内撤销；

(5) 场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定；

(6) 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

### 4、申购和赎回的程序

#### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### (2) 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况并妥善行使合法权利。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### (3) 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金份额登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

## 5、申购与赎回的数额限制

(1) 投资者通过其他销售机构申购本基金，单笔最低申购金额为10元。通过基金管理人直销中心申购本基金，首次最低金额为10元，追加申购单笔最低金额为10元；

(2) 投资者单个交易账户不设最低持有基金份额限制；

(3) 本基金对单个投资者累计持有的基金份额不设限制；

(4) 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 6、申购费用和赎回费用

### (1) 申购费用

本基金的场外申购费率最高不超过申购金额的0.50%，且随投资者申购金额的增加而减少。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金场外申购费率如下表：

申购金额（元）	申购费率
M < 50 万	0.50%
M ≥ 50 万	每笔 100 元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。



## （2）赎回费用

本基金的场外赎回费率最高不超过赎回金额的0.50%，且随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场外赎回费率如下表（1年为365日）：

持有年限 Y	赎回费率
$Y < 1$ 年	0.50%
$1 \text{年} \leq Y < 2$ 年	0.25%
$Y \geq 2$ 年	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（3）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒介公告。

（4）基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 7、申购份额与赎回金额的计算

### （1）基金份额净值的计算

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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，由此产生的误差计入基金财产。

### （2）申购份额的计算

基金的申购采用“金额申购”方式，申购金额包括申购费用和净申购金额，

计算公式如下：

1) 当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法为：

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；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

2) 当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法为：

申购费用 = 固定金额

净认购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份数 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

申购的有效份额由按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场外申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者在场外申购本基金50,000元，对应的申购费率为0.50%。假设申购当日基金份额净值为1.386元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = 50,000 / (1 + 0.50%) = 49,751.24元；

申购费用 = 50,000 - 49,751.24 = 248.76元；

申购份额 = 49,751.24 / 1.386 = 35,895.56份。

即，若该投资者在场外申购本基金50,000元，假设申购当日基金份额净值为1.386元，则可得到基金份额35,895.56份。

(3) 赎回金额的计算

基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T日基金份额净值；

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率；

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用。

赎回金额为实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用后的余额。场外赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以

后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者在场外赎回本基金100,000份，持有时间为一年六个月，对应的赎回费率为0.25%。假设赎回当日基金份额净值为1.483元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额=100,000×1.483=148,300.00元；

赎回费用=148,300.00×0.25%=370.75元；

净赎回金额=148,300.00-370.75=147,929.25元。

即，若该投资者在场外赎回本基金100,000份，持有时间为一年六个月，假设赎回当日基金份额净值为1.483元，则可得到147,929.25元。

#### 8、申购和赎回的注册登记

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

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

基金登记机构可以在法律法规允许的范围内，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，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一家指定媒介公告。

9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券、期货交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- （4）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （5）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- （6）可能有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述第1、2、3、4、5项暂停申购情形时且基金管理人决定暂停申购的，

基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

#### 10、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券、期货交易场所依法决定临时停市，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) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续2个或2个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (5) 接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- (6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。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公告。

#### 11、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建信有色份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括建信有色份额、建信有色A份额、建信有色B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赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括建信有色份额、建信有色A份额、建信有色B份额）的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以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)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

4) 当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相应规则进行处理。

5) 巨额赎回的公告：当发生上述延期赎回并延期办理时，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3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 12、重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

(2) 如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介

上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

(3) 如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

(4) 如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。当连续暂停时间超过2个月的，基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

## （二）基金份额的场内申购与赎回

### 1、申购和赎回场所

投资者办理本基金场内申购业务的场所为具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，办理本基金场内赎回业务的场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 2、申购和赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2日在至少一家指定媒介及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

申购和赎回的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

基金管理人不得在《基金合同》约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在《基金合同》约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，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。

### 3、申购和赎回的原则

- (1) “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；
- (2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- (3) 当日的场内申购与赎回申请可以在深圳证券交易所规定的时间以内撤销；
- (4) 场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、基金登记机构的相关业务规定；
- (5) 基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### 4、申购和赎回的程序

##### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### (2) 申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况并妥善行使合法权利。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

##### (3) 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损

失由投资者自行承担。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金份额登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

## 5、申购与赎回的数额限制

（1）投资者通过深圳证券交易所会员单位申购本基金，单笔最低申购金额为50,000元；

（2）基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 6、申购费用和赎回费用

### （1）申购费用

本基金的场内申购费率由深圳证券交易所会员单位按照场外申购费率设定。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

### （2）赎回费用

本基金的场内赎回费率为固定费率0.50%，不按持有期限设置分段赎回费率。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（3）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒介公告。

（4）基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下



根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 7、申购份额与赎回金额的计算

### （1）基金份额净值的计算

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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，由此产生的误差计入基金财产。

### （2）申购份额的计算

基金的申购采用“金额申购”方式，申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})；$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}；$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}。$$

申购的有效份额由按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。场内申购份额计算结果保留到整数位，小数部分舍弃，对应的资金返还至投资者资金账户（返还金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金资产）。

例：某投资者在场内申购本基金50,000元，对应的申购费率为0.50%。假设申购当日基金份额净值为1.386元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.50\%) = 49,751.24\text{元}；$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,751.24 = 248.76\text{元}；$$

$$\text{申购份额} = 49,751.24 / 1.386 = 35,895\text{份}；$$

$$\text{实际净申购金额} = 35,895 \times 1.386 = 49750.47\text{元}；$$

$$\text{实际申购金额} = 49750.47 \times (1 + 0.50\%) = 49,999.22235\text{元}；$$

实际申购费用 =  $49,999.22235 - 49750.47 = 248.75235$ 元；

返还金额 =  $50,000 - 49,999.22235 = 0.77$ 元。

即，若该投资者在场内申购本基金50,000元，假设申购当日基金份额净值为1.386元，则可得到基金份额35,895份，申购资金返还0.77元。

### （3）赎回金额的计算

基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T日基金份额净值；

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率；

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用。

赎回金额为实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用后的余额。场内赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者在场内赎回本基金100,000份，赎回费率为0.50%。假设赎回当日基金份额净值为1.383元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $100,000 \times 1.383 = 138,300.00$ 元；

赎回费用 =  $138,300.00 \times 0.50\% = 691.50$ 元；

净赎回金额 =  $138,300.00 - 691.50 = 137,608.50$ 元。

即，若该投资者在场内赎回本基金100,000份，假设赎回当日基金份额净值为1.383元，则可得到137,608.50元。

## 8、其他

有关场内拒绝或暂停申购的情形及处理方法、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式、巨额赎回的情形及处理方式、重新开放申购或赎回的公告、基金的转换、定期定额投资计划等内容请参见基金合同中关于“基金份额的申购与赎回”部分的相关规定以及深圳证券交易所、基金登记机构的有关规定，并据此执行。

### （三）基金的转换

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，相关规则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。

#### **（四）定期定额投资计划**

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 十二、基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻

### （一）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### （二）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

#### 1、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理建信有色份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有建信有色份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理建信有色份额场内赎回或建信有色A 份额与建信有色B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### 2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的建信有色份额在注册登记

系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2) 场内份额跨系统转托管至场外后，持有期限将重新计算，赎回时按变更后的持有期限计算适用赎回费率。

(3) 建信有色份额跨系统转托管的具体业务按照基金登记机构的相关业务规定办理。

3、基金管理人、基金登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒介公告。

### **(三) 基金份额的冻结和解冻**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十三、基金份额的配对转换

基金合同生效后，基金管理人将为场内基金份额持有人办理基金份额配对转换。基金份额的配对转换是指建信有色份额与建信有色A份额、建信有色B份额之间的转换，包括基金份额的分拆与合并。

建信有色份额的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

### （一）配对转换场所

基金份额配对转换业务的办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在配对转换业务办理机构的营业场所或按办理机构提供的其他方式办理本基金的份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

### （二）配对转换的开放日及时间

基金份额的配对转换业务自建信有色A份额与建信有色B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理配对转换业务的具体日期前 2 日在至少一家指定媒介公告。

配对转换的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停配对转换时除外），投资者应当在开放日办理配对转换业务。具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对配对转换业务的办理时间进行调整，但此项调整应在实施日 2 日前在至少一家指定媒介公告。

### （三）配对转换的原则

- 1、配对转换以份额申请；
- 2、申请进行分拆的建信有色份额的场内份额数必须为偶数；
- 3、申请进行合并的建信有色 A 份额与建信有色 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须为整数且相等；

4、建信有色份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为建信有色份额的场内份额后方可进行；

5、配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒介公告。

#### **（四）配对转换的程序**

配对转换的程序遵循届时相关机构发布的相关业务规则，具体见相关业务公告。

#### **（五）暂停配对转换的情形**

1、深圳证券交易所、基金登记机构、配对转换业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形；

2、基金管理人认为继续接受配对转换可能损害基金份额持有人利益的情形；

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在至少一家指定媒介刊登暂停基金份额配对转换公告。

在暂停配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复该业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒介公告。

#### **（六）配对转换费用**

配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情收取一定的费用，具体见相关业务公告。

#### **（七）其他事项**

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金《基金合同》将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 十四、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

### （二）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### （三）标的指数

中证申万有色金属指数

在出现以下两种情况时：

1、如果标的指数可能存在的不合理性导致其不能很好地反映沪深两市属于有色金属产业的公司股票的整体走势，或随着中国证券市场的进一步发展和完善，未来出现了更合理、更具代表性的反映该类股票走势的指数时，基金管理人可在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数。

2、当标的指数出现下列问题时，基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更基金的标的指数：

（1）上海证券交易所或深圳证券交易所停止向标的指数供应商提供标的指



数所需的数据、限制其从交易所取得数据或处理数据的权利；

(2) 标的指数被上海证券交易所及深圳证券交易所停止发布；

(3) 标的指数由其他指数替代；

(4) 标的指数供应商停止编辑、计算和公布标的指数点位或停止对基金管理人的标的指数使用授权；

(5) 标的指数由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的标的指数；

(6) 存在针对标的指数或标的指数供应商的商业纠纷或法律诉讼，且此类纠纷或诉讼可能对标的指数或基金管理人使用标的指数的能力产生重大不利影响。

基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而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。

标的指数更换后，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。

#### **(四) 投资策略**

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金力争建信有色份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。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。

## 1、股票投资策略

### (1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

### (2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证建信有色份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

#### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### 2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

## 2、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

### 3、股指期货、权证等投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、

交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

## （五）业绩比较基准

中证申万有色金属指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

中证申万有色金属指数从中证全指样本空间内，首先将样本空间中最近一年(新股为上市以来)的日均成交金额处于最低 20%的股票剔除；其次将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名；最后，根据申万行业分类标准，选择归属于有色金属行业的日均总市值排名前 50 位的股票构成中证申万有色金属指数样本股，数量不足则按实际数量选入。

如果中证申万有色金属指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目标指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的

前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而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。

## （六）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，建信有色 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；建信有色 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

## （七）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

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

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（8）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过

该资产支持证券规模的 10%；

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

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产净值的 90%；

(18) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(19) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

- (6) 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；  
 (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，不需要经基金份额持有人大会审议。

## (八) 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。

## (九) 基金的投资组合报告

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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日，本投资组合报告中财务资料未经审计。

### 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	51,472,657.54	88.45
	其中：股票	51,472,657.54	88.45
2	基金投资		
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,143,439.56	7.12
8	其他资产	2,579,827.74	4.43
9	合计	58,195,924.84	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	-	-
B	采矿业	16,745,657.33	30.64
C	制造业	33,293,972.21	60.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,039,629.54	91.57

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	310,000.00	0.57
C	制造业	1,123,028.00	2.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,433,028.00	2.62

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

## 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	601899	紫金矿业	845,400	2,848,998.00	5.21
2	600111	北方稀土	194,300	2,586,133.00	4.73
3	600547	山东黄金	63,500	2,470,785.00	4.52
4	002466	天齐锂业	53,140	2,268,546.60	4.15
5	601600	中国铝业	488,600	1,842,022.00	3.37
6	600489	中金黄金	153,922	1,730,083.28	3.17
7	002340	格林美	181,700	1,593,509.00	2.92
8	000630	铜陵有色	596,800	1,515,872.00	2.77
9	603993	洛阳钼业	347,700	1,442,955.00	2.64
10	000060	中金岭南	138,100	1,440,383.00	2.64

### 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

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	000511	*ST 烯碳	125,900	1,123,028.00	2.06
2	000693	ST 华泽	24,800	310,000.00	0.57

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、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投资股指期货。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

##### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

##### 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投资国债期货。

##### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

11.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,867.51
2	应收证券清算款	2,299,813.97
3	应收股利	-
4	应收利息	1,400.59
5	应收申购款	221,745.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,579,827.74

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 11.5.2 报告期末极投投资前五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	000511	*ST 烯碳	1,123,028.00	2.06	重大事项
2	000693	ST 华泽	310,000.00	0.57	重大事项



## 十五、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 6 月 30 日。

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。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
基金合同生效之日 2015 年 8 月 6 日— 2015 年 12 月 31 日	-0.26%	0.05%	-1.40%	2.75%	1.14%	-2.70%
2016 年 1 月 1 日- 2016 年 6 月 30 日	4.81%	2.01%	-5.51%	2.56%	10.32%	-0.55%
基金合同生效之日 2015 年 8 月 6 日— 2016 年 6 月 30 日	4.54%	1.49%	-6.83%	2.64%	11.37%	-1.15%

## 十六、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金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销；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销。

## 十七、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、股指期货、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股和配股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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

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

3、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。

4、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。

5、股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

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

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1、建信有色基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当



日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

#### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金资产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人 and 基金托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基

金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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净值予以公布。

### (八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所、登记结算公司或标的指数供应商发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十八、基金的收益分配

### （一）基金的利润构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）收益分配原则

在存续期内，本基金（包括建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额）不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 十九、基金份额的折算

### （一）定期份额折算

在建信有色 A 份额、建信有色份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。第一个定期折算期间指基金合同生效日至基金合同生效日之后最近一个 11 月 30 日，第二个及之后的定期折算期间指每个会计年度的 12 月 1 日至下一会计年度的 11 月 30 日。

#### 1、基金份额折算基准日

正常情况下，基金份额定期折算基准日为每个会计年度 12 月第一个工作日。但定期折算基准日前 15 日（含）内发生过不定期折算的，则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算的，基金管理人应按信息披露办法的规定在至少一家指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公告。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信有色 A 份额、建信有色份额。

#### 3、基金份额折算频率

每年折算一次（可不进行定期折算的除外）。

#### 4、基金份额折算方式

建信有色 A 份额与建信有色 B 份额按照本招募说明书第七部分“基金份额的净值计算”进行基金份额参考净值计算，对建信有色 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算。

在基金份额折算前与折算后，建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于建信有色 A 份额的约定应得收益，即建信有色 A 份额每个会计年度 11 月 30 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内建信有色份额分配给建信有色 A 份额持有人。建信有色份额持有人持有的每 2 份建信有色份额将按 1 份建信有色 A 份额获得新增建信有色份额的分配。持有场外建信有色份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信有色份额的分配；持有场内建信有色份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信有色份额的分配。经过上述份额折算，建信有色 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，建信有色份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度 12 月第一个工作日为基金份额折算基准日（可不进行定期折算的除外），本基金将对建信有色 A 份额和建信有色份额进行定期份额折算。

有关计算公式如下：

(1) 建信有色 A 份额

定期份额折算不改变建信有色 A 份额的份额数，即

$$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色 A 份额的份额数。

因持有建信有色 A 份额而新增的场内建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增, 建信有色 A 份额}} = \frac{NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}} \times (NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000)}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色份额的基金份额净值，计算公式

式为

$$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$$

$$= \frac{\text{定期折算前全部建信有色份额的基金资产净值} - 0.5 \times (NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}$$

定期份额折算后的建信有色份额的基金份额净值，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(2) 建信有色 B 份额

定期份额折算不改变建信有色 B 份额的基金份额参考净值及其份额数，即

$$NAV_{\text{建信有色B份额}}^{\text{参考, 定期后}} = NAV_{\text{建信有色B份额}}^{\text{参考, 定期前}}$$

$$NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{定期前}}$$

### (3) 建信有色份额

定期份额折算后建信有色份额的份额数等于定期折算前建信有色份额的份额数与新增的建信有色份额的份额数之和，即

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}} + NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}}$$

建信有色份额持有人新增的建信有色份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} = \frac{0.5 \times (NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}}$$

其中，

$NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}$ ：定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}$ ：定期份额折算后建信有色份额的基金份额净值，计算公式同上。

### 5、定期份额折算示例

假设本基金成立后第 2 年 12 月第一个工作日为定期份额折算基准日，建信有色份额当天折算前资产净值为 8,659,000,000 元。当天场外建信有色份额、场内建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的份额数分别为 55 亿份、10 亿份、20 亿份、20 亿份。前一个会计年度末每份建信有色 A 份额资产净值为 1.065 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的建信有色 A 份额和建信有色份额，即 20 亿份和 65 亿份。

#### (1) 建信有色 A 份额持有人

定期折算后持有的建信有色 A 份额为

$$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期后}} = NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期前}} = 20\text{亿份}$$

定期份额折算后建信有色份额的份额净值为

$$\begin{aligned}
& NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} \\
&= \frac{\text{定期折算前全部建信有色份额的基金资产净值} - 0.5 \times \left( NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}} \\
&= \frac{8,69,000,000 - 0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{6,500,000,000} = 1.300 \text{元}
\end{aligned}$$

因持有建信有色 A 份额而新增的场内建信有色份额的份额数为

$$\begin{aligned}
NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增, 建信有色A份额}} &= \frac{NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{定期前}} \times \left( NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right)}{NAV_{\text{建信网金份额}}^{\text{定期后}}} \\
&= \frac{2,000,000,000 \times (1.065 - 1.000)}{1.300} = 100,000,000 \text{份}
\end{aligned}$$

建信有色 A 份额持有人在定期折算后总共持有 20 亿份建信有色 A 份额，基金份额净值为 1.0000 元；新增持有 100,000,000 份建信有色份额，基金份额净值为 1.300 元。

## (2) 建信有色份额持有人

建信有色份额持有人新增的建信有色份额数为

$$\begin{aligned}
NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} &= \frac{0.5 \times \left( NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 定期前}} - 1.000 \right) \times NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}}}{NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}}} \\
&= \frac{0.5 \times (1.065 - 1.000) \times 6,500,000,000}{1.300} = 162,500,000 \text{份}
\end{aligned}$$

建信有色份额持有人在定期折算后持有的建信有色份额为

$$\begin{aligned}
NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期后}} &= NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期前}} + NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{定期新增}} \\
&= 6,500,000,000 + 162,500,000 = 6,662,500,000 \text{份}
\end{aligned}$$

## (二) 不定期折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即当建信有色份额的基金份额净值达到 1.500 元时或当建信有色 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时。

### 1、基金份额折算基准日

当达到不定期折算条件时，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额。



### 3、基金份额折算频率

不定期。

### 4、基金份额折算方式

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

(1) 当建信有色份额的份额净值达到 1.500 元时，建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额将按照如下公式进行份额折算：

#### 1) 建信有色 A 份额

① 份额折算前建信有色 A 份额的份额数与份额折算后建信有色 A 份额的份额数相等，即

$$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 A 份额的份额数。

② 份额折算前建信有色 A 份额持有人在份额折算后将持有建信有色 A 份额与新增场内建信有色份额，且所对应的基金资产净值不变。

建信有色 A 份额持有人新增的场内建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期新增, 建信有色A份额}} = \frac{NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期前}} \times \left( NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - 1.000 \right)}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值。

#### 2) 建信有色 B 份额

① 份额折算前建信有色 B 份额的份额数与份额折算后建信有色 B 份额的份额数相等

$$NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期后}} = NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期前}}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 B 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 B 份额的份额数。

② 份额折算前建信有色 B 份额持有人在份额折算后将持有建信有色 B 份额与新增场内建信有色份额，且所对应的基金资产净值不变。

建信有色 B 份额持有人新增的场内建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期新增, 建信有色B份额}} = \frac{NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期前}} \times (NAV_{\text{建信有色B份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色B份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 B 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色B份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 B 份额的基金份额参考净值。

### 3) 建信有色份额

建信有色份额持有人份额折算前后所持有的建信有色份额的资产净值不变。场外建信有色份额持有人份额折算后获得新增场外建信有色份额，场内建信有色份额持有人份额折算后获得新增场内建信有色份额。

建信有色份额持有人不定期份额折算后的建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色份额的基金份额净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色份额的份额数。

(2) 当建信有色 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额将按照如下公式进行份额折算：

#### 1) 建信有色 B 份额

份额折算前后建信有色 B 份额所对应的基金资产净值不变，即

$$NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 B 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 B 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 B 份额的份额数。

## 2) 建信有色 A 份额

① 份额折算后建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的份额数保持 1: 1 配比，

即

$$\begin{aligned} NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期后}} &= NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期后}} \\ &= \frac{NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}}{1.000} \\ &= \frac{NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{参考, 不定期前}}}{1.000} \end{aligned}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 A 份额的份额数，

$NUM_{\text{建信有色 B 份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 B 份额的份额数。

② 份额折算前建信有色 A 的持有人在份额折算后将持有建信有色 A 份额与新增场内建信有色份额，且所对应的基金资产净值不变。

建信有色 A 份额持有人新增的场内建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期新增}} = \frac{NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{参考, 不定期前}} - NUM_{\text{建信有色 A 份额}}^{\text{不定期后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色A份额}}^{\text{参考, 不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色 A 份额的基金份额参考净值，

$NUM_{\text{建信有色A份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色 A 份额的份额数。

### 3) 建信有色份额

建信有色份额持有人份额折算前后所持有的建信有色份额的资产净值不变。场外建信有色份额持有人份额折算后获得新增场外建信有色份额，场内建信有色份额持有人份额折算后获得新增场内建信有色份额。

建信有色份额持有人不定期份额折算后的建信有色份额的份额数为

$$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期后}} = \frac{NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}} \times NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色份额的份额数，

$NAV_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期前}}$ ：不定期份额折算前建信有色份额的基金份额净值，

$NUM_{\text{建信有色份额}}^{\text{不定期后}}$ ：不定期份额折算后建信有色份额的份额数。

### 5、不定期份额折算示例

#### (1) 建信有色份额的基金份额净值达到 1.500 元

设在本基金的不定期份额折算日，建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
建信有色份额	1.536 元	10,000 份	1.000 元	15,360 份建信有色份额

建信有色A份额	1.028元	10,000份	1.000元	10,000份建信有色A份额 +280份建信有色份额
建信有色B份额	2.044元	10,000份	1.000元	10,000份建信有色B份额 +10,440份建信有色份额

(2) 建信有色 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元

设在本基金的不定期份额折算日，建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元，则各持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额 10,000 份的基金份额持有人所持基金份额的变化如下表所示：

	折算前		折算后	
	份额净值/ 份额参考净值	份额数	份额净值/ 份额参考净值	份额数
建信有色份额	1.536 元	10,000 份	1.000 元	6,170 份建信有色份额
建信有色 A 份 额	1.028 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份建信有色 A 份 额 +8,220 份建信有色份额
建信有色 B 份 额	2.044 元	10,000 份	1.000 元	2,060 份建信有色 B 份 额

### (三) 基金份额折算余额的处理方法

份额折算后场外基金份额的份额数计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，余额计入基金财产；场内基金份额的份额数计算结果保留到整数位，余额的处理方法按照深圳证券交易所或基金登记机构的相关规则及有关规定执行。

### (四) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，届时基金管理人可根据深圳证券交易所、基金登记机构的相关业务规定暂停建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的上市交易、建信有色份额的申购与赎回、建信有色份额与建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的份额配对转换等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### (五) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒介公告，并报中国证监会备案。

### **（六）特殊情形的处理**

若在某定期折算期间最后一个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，可根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

### **（七）其他事项**

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金《基金合同》将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 二十、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费和年费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00 \% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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双方核对无误后，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费 本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足10,000元的，按10,000元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前10个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在至少一家指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；



4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **（四）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 二十一、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 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年度的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账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、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。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 二十二、基金的信息披露

### （一）信息披露法律依据

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

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （三）信息披露禁止行为

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

### （四）信息披露形式

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

### 2、基金份额发售公告

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

### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

### 4、基金份额上市交易公告书

建信有色A份额与建信有色B份额获准在深圳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前至少3个工作日，将基金份额上市交易公告书登载于指定媒介上。

### 5、基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值

《基金合同》生效后，在建信有色A份额与建信有色B份额开始上市交易前或建信有色份额开始办理申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、建信有色份额的基金份额净值、建信有色A份额与建信有色B份额的基金份额参考净值。

在建信有色A份额与建信有色B份额开始上市交易后或建信有色份额开始办理申购或者赎回后，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，披露开放日建信有色份额的基金份额净值和基金份额累计净值、建信有色A份额与建信有色B份额的基金份额参考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、建信有色份额的基金份额净值、建信有色A份额与建信有色B份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、建信有色份额的基金份额净值和基金份额累计净值、建信有色A份额与建信有色B份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

#### 6、基金份额申购、赎回价格

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建信有色份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

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

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人

主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

## 8、临时报告

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

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (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) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 本基金开始办理或暂停接受份额配对转换申请；
- (27) 本基金暂停接受份额配对转换申请后重新接受份额配对转换；
- (28) 本基金进行基金份额折算；
- (29) 本基金在该会计年度12月第一个工作日不进行定期折算（如若在定期折算日前15日（含）内发生过不定期折算的，则该年度可不进行定期折算）；
- (30) 本基金暂停上市、恢复上市或终止上市；
- (31) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

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

## 11、投资于股指期货等金融期货的信息

若本基金投资股指期货等金融期货，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露金融期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示金融期货交易

对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

## 12、资产支持证券

本基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露资产支持证券的投资情况。

## （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、建信有色份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共

媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

## （七）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的住所，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，以供公众查阅、复制。



## 二十三、风险揭示

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，建信有色 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；建信有色 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、操作风险、流动性风险、信用风险、本基金特有风险（包括作为指数基金的风险、作为上市基金的风险和作为分级基金的风险）及其他风险等。

### （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

利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致基金所投资的上市公司业绩及其股票价格发生波动，使得基金的收益产生变化。

#### 5、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，

使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

#### 6、 购买力风险

因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### **（二）管理风险**

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

### **（三）操作风险**

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。这种风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售代理机构等。

### **（四）流动性风险**

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

### **（五）信用风险**

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

### **（六）投资本基金特有的风险**

#### 1、作为指数基金存在的风险

##### （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）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据《基金合同》规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

## （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) 成份股派发现金红利等将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度；

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

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

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

7) 其他因素，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。

## 2、作为上市基金存在的风险

### （1）暂停上市或终止上市的风险

在《基金合同》生效且本基金符合上市交易条件后，建信有色 A 份额和建信有色 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露

导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将建信有色 A 份额和建信有色 B 份额通过份额配对转换转为建信有色份额并转托管至场外后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

### （2）基金份额折溢价的风险

本基金建信有色 A 份额和建信有色 B 份额在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然份额配对转换套利机制设计已将基金份额折溢价的风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

## 3、作为分级基金存在的风险

### （1）分级机制风险

本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。但由于本基金存在分拆的两类基金份额，分级机制令两类基金份额具有不同的风险收益特征，从而带来不同于跟踪标的指数的指数基金的风险：建信有色 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；建信有色 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

### （2）份额折算风险

1) 本基金份额折算时，投资者所持基金份额可能发生变化，形成与之前所持基金份额组合不同的风险收益特征，从而产生风险；

2) 本基金份额折算时，场外份额数保留至小数点后两位，场内份额数保留至整数位，剩余部分舍弃并计入基金资产。该尾差处理原则可能给投资者带来损失，从而产生风险；

3) 当投资者通过不具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位买卖基金份额时，可能无法赎回份额折算后新增的基金份额，从而产生风险。

### （3）配对转换风险

《基金合同》生效后，在本基金的存续期内，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理建信有色份额与建信有色 A 份额、建信有色 B 份额之间的配对

转换。配对转换业务的办理可能改变建信有色 A 份额和建信有色 B 份额的市场供求关系，影响基金份额的交易价格，从而产生风险；该业务也可能出现暂停办理或申请无法确认的情形，从而产生风险。

### （七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售代理机构等机构无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二十四、基金的终止与清算

### （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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的；或《基金合同》生效三年后继续存续的，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
  - (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
  - (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
  - (7) 对基金财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### **（四）清算费用**

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

#### **（五）基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自的应计分配比例，并据此向建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

#### **（六）基金财产清算的公告**

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

#### **（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。



## 二十六、基金托管协议的内容摘要

托管协议的内容摘要见附件二。

## 二十七、对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。公司承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，积极增加服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

(一) 客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）、010-66228000

### 1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金净值查询、账户信息查询、公司信息查询、基金信息查询等。

### 2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至每周五，上午 9：00～17：00 的人工电话咨询服务。

### 3、客户留言服务

投资者可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知公司客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

(二) 订制对账单服务

投资者可以通过本公司客户服务电话、电子邮箱、传真、信件等方式订制对账单服务。本公司在准确获得投资者邮寄地址、手机号码及电子邮箱的前提下，将为已订制账单服务的投资者提供电子邮件、短信和纸质对账单：

### 1、电子邮件对账单

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的持有人发送电子对账单。

### 2、短信对账单

短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功订制短信对账单服务的持有人发送短信对账单。

### 3、纸质对账单

纸质对账单是通过平信向基金份额持有人提供份额对账的一种账单形式。纸质对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。我公司在每季度或年度结束后的 15 个工作日内向预留了准确邮寄地址并成功订制纸质对账单服务的持有人寄送纸质对账单。

### 4、对账单补寄

投资者提出补寄需求后，我公司将于 15 个工作日内安排寄出。

#### （三）网站服务（[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、公司动态及相关信息等。

2、账户查询：投资者可通过网上“账户查询”服务查询账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资者还可通过“账户查询修改”、“查询密码修改”自助修改基本信息及查询密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷的下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好的了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资者的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

#### （四）短信服务

若投资者准确完整的预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆公司网站添加后定制此项服务。

#### （五）电子邮件服务

若投资者准确完整的预留了电子邮箱地址，可获得免费电子邮件服务，包括产品信息、公司最新公告等。未预留电子邮箱地址的投资者可拨打客服电话或登录公司网站添加后订制此项服务。

#### （六）微信、易信服务

我公司通过官方微信、易信等即时通讯服务平台为投资者提供理财资讯及基金信息查询等服务。投资者可在微信、易信中搜索“建信基金”或者“ccbfund”添加关注。

投资者通过公司官方微信、易信可查询基金净值、产品信息、分红信息、理财资讯等内容。已开立建信基金账户的投资者，将微信、易信账号与基金账号绑定后可查询基金份额、交易明细等信息。

#### （七）密码解锁/重置服务

为保证投资者账户信息安全，当拨打客服电话或登陆公司网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达6次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

#### （八）客户建议、投诉处理

投资者可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信、传真等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

## 二十八、其他应披露事项

自 2016 年 2 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日，本基金的临时公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增中国民生银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-08-05
2	关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-07-15
3	关于新增平安证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-06-03
4	关于新增上海长量为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-05-25
5	建信基金管理有限责任公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-04-15
6	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016-02-05

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 查阅上述公告。

## 二十九、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 三十、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、《关于准予建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金注册的批复》
- 2、《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

- 1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

## 附件一、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利与义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或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或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其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；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；



- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 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《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金

提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、谨慎勤勉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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 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，按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值，确定建信有色份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 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；

(12) 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

保密，不向他人泄露；

(13) 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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(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) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

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

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》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；

(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；

(23) 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；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户和证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，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；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额参考净值、建信有色份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》及《托管协议》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人，但因涉及本基金与其它基金合并的除外；

(4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外）；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

3、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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管

理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额 10%以上（含 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，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，单独或合计持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额 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的，单独或合计持有建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额 10%以上（含 10%）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。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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）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）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；



- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（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，有效的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额少于本基金在权益登记日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金总份额的

二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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到会者在权益登记日代表的有效的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有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。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（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，基金份额持有人所持有的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额不小于在权益登记日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额小于在权益登记日建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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（含三分之一）以上建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意

见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

###### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公

证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额在其对应的份额类别内有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自基金份额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）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具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。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）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和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会

议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(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) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，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（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议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 个工作日内在指定媒介上公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方法

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

在存续期内，本基金（包括建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、基金财产管理、运用相关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费和年费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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双方核对无误后，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 10,000 元的，按 10,000 元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数

供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在至少一家指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终



在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

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

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

（10）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产净值的 90%；

(18) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(19) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合

同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## （二）基金资产净值、基金份额净值和基金份额参考净值的公告方式

《基金合同》生效后，在建信有色 A 份额、建信有色 B 份额开始上市交易前或建信有色份额开始办理申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值。

在建信有色 A 份额与建信有色 B 份额开始上市交易后或建信有色份额开始办理申购或者赎回后，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，披露开放日建信有色份额的基金份额净值和基金份额累计净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考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、建信有色份额的基金份额净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、建信有色份额的基金份额净值和基金份额累计净值、建信有色 A 份额与建信有色 B 份额的基金份额参考净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## 七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的；

或《基金合同》生效三年后继续存续的，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；

- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算建信有色份额、

建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自的应计分配比例，并据此向建信有色份额、建信有色 A 份额、建信有色 B 份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

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

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 附件二、托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

成立日期：2005年9月19日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会、中国证监会证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### (二) 基金托管人

名称：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号

法定代表人：何如

成立日期：1994年6月30日

组织形式：股份有限公司

注册资本：82亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2013】1666号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管。

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选

择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

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

（1）投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；



(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

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

(7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

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

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

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

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

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%, 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(14) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;

(15) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%。其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(16) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

(17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计

（轧差计算）应当不低于基金资产净值的 90%；

（18）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（19）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

（20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本

托管协议第 15 条第（十二）款“基金投资禁止行为”进行监督。基金托管人对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定与关联交易名单中列示的关联方进行关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单和交易结算方式进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现

基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易结算方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

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

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

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。。基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于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。

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

(九) 若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、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，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

正的，基金托管人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）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。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的托管资金专门账户和证券账户。
- 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. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。
7. 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）募集资金的验证

- 1、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的建信基金管理有限责任公司“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的托管资金专门账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或

2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应予以必要协助。

### （三）基金的托管资金专门账户的开立和管理

1. 基金托管人以基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开设托管资金专门账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 托管资金专门账户的开立和使用，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。

3. 托管资金专门账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

3. 基金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. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等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. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### （五）债券托管账户的开立和管理

《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结



算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开设和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。建信有色份额净值

是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。法律法规另有规定的，从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个交易日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、股指期货、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2. 估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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；

3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确

定公允价格；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

(3) 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。

(4) 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。

(5) 股指期货合约，以估值日结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的结算价估值。

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

(7) 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责

任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

1. 当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

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

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

(2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

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

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

3. 由于证券交易所及登记结算公司或标的指数供应商发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

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

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1. 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

## 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

## 3. 财务报表的编制与复核时间安排

### (1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《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。

### (2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

(八) 基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括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由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方法

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

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 《基金合同》终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

本页无正文，为《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金招募说明书》签章页。

建信基金管理有限责任公司

二〇一六年十月一日