

建信深证 100 指数增强型证券投资基金
招募说明书（更新）

2017 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：交通银行股份有限公司

二〇一七年十月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 12 月 28 日证监许可[2011]2130 号文核准募集。本基金的基金合同于 2012 年 3 月 16 日正式生效。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

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新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 9 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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

第一部分 前言	4
第二部分 释义	5
第三部分 基金管理人	9
第四部分 基金托管人	18
第五部分 相关服务机构	22
第六部分 基金的募集	30
第七部分 基金合同的生效	34
第八部分 基金份额的申购与赎回	36
第九部分 基金的投资	45
第十部分 基金的业绩	58
第十一部分 基金的财产	59
第十二部分 基金资产的估值	61
第十三部分 基金的收益分配	68
第十四部分 基金的费用与税收	70
第十五部分 基金的会计与审计	73
第十六部分 基金的信息披露	74
第十七部分 风险揭示	78
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	82
第十九部分 基金合同内容摘要	84
第二十部分 基金托管协议的内容摘要	106
第二十一部分 对基金份额持有人的服务	124
第二十二部分 其他应披露事项	127
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式	128
第二十四部分 备查文件	129

第一部分 前言

《建信深证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关法律法规的规定以及《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《基金合同》）编写。

本招募说明书阐述了建信深证 100 指数增强型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

第二部分 释义

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：指建信深证 100 指数增强型证券投资基金；
- 2、基金合同：指《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
- 3、招募说明书：指《建信深证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
- 4、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信深证 100 指数增强型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；
- 5、业务规则：指《建信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》；
- 6、发售公告：指《建信深证 100 指数增强型证券投资基金份额发售公告》；
- 7、中国：指中华人民共和国（仅为《基金合同》目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）；
- 8、中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 9、中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修订的《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；
- 11、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布，同年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 12、《销售办法》：指 2011 年 6 月 9 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》；
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布，同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》；
- 14、元：指人民币元；
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
- 16、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司；
- 17、基金托管人：指交通银行股份有限公司；
- 18、基金份额持有人：指依照法律法规、招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资人；

19、注册登记业务：指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

20、注册登记人：指办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记人为建信基金管理有限责任公司或建信基金管理有限责任公司委托代为办理基金注册登记业务的机构；

21、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者；

22、个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人；

23、机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；

24、合格境外机构投资者：指符合法律法规规定，经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；

25、基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；

26、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》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

27、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；

28、工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

29、发售：指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为；

30、认购：指在基金募集期内，投资人按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

31、申购：指在基金存续期内，投资人申请购买本基金基金份额的行为；

32、赎回：指基金存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人将其持有的本基金基金份额兑换为现金的行为；

33、巨额赎回：指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形；

34、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的、已开通基金转换业务的其他基金份额间的转换行为；

35、转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额

从一个交易账户转入另一交易账户的行为；

36、代销机构：指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；

37、销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；

38、基金销售网点：指基金管理人的直销机构及基金代销机构的代销网点；

39、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；

40、基金账户：指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

41、交易账户：指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；

42、开放日：指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；

43、T 日：指销售机构在规定时间内受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；

44、T+n 日：指 T 日起（不包括 T 日）的第 n 个工作日；

45、基金收益：指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息和其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本或费用的节约；

46、基金资产总值：基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和；

47、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；

48、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值；

49、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；

50、法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充；

51、不可抗力：指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用和没收、法律法规变化、突发停电、恐怖袭击、传染病传播、证券交易场所非正常暂停或停止交易以及其他突发事件。

第三部分 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：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者的利益。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裁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，高级经济师，享受国务院特殊津贴，中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983 年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业，获学士学位。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，2006 年 5 月起任中国建设银行河南省分行行长，2011 年 3 月出任中国建设银行批发业务总监，2015 年 3 月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

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，现任信安北亚地区副总裁。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。

郑树明先生，董事，现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989 年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团有限公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD）。

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

张军红先生，监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任

科员；零售业务部主任科员；个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理；行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理；投资托管服务部总经理助理、副总经理；投资托管业务部副总经理；资产托管业务部副总经理。2017 年 3 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。方女士 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战略研究部总经理。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责任公司企业融资部经理。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003 年 7 月毕业于中国人民大学行政管理专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005 年 8 月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）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内控合规部。

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系，获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部，中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长，建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

曲寅军先生，副总裁，硕士。1999 年 7 月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、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、专户投资部总监和首席战略官；2013 年 8 月至 2015 年 7 月，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。2015 年 8 月 6 日起任我公司副总裁，并专任建信资本管理

有限责任公司董事、总经理。

张威威先生，副总裁，硕士。1997 年 7 月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001 年 1 月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券投资基金销售业务，任高级副经理；2005 年 9 月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，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 日起任我公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。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，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006 年 3 月加入我公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015 年 8 月 6 日起任我公司督察长，2016 年 12 月 23 日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996 年 7 月至 1998 年 9 月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001 年 7 月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、业务经理、高级经理助理；2005 年 9 月加入建信基金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016 年 12 月 23 日起任我公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

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），博士。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、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 日至 2016 年 10 月 25 日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。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁女士，固定收益投资部总经理。

姚锦女士，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部基金经理。

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、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内控合规部，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。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2016 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 13 位，较上年上升 4 位；根据 2016 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 153 位，较上年上升 37 位。

截至 2017 年 6 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 89308.38 亿元。2017 年 1-6 月，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 389.75 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 6 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 298 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、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，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部业务风险管理暂行办法》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行须报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

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。

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

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（4）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：www.95559.com.cn

（5）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

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

（6）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

（7）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（8）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

客服电话：95541

网址：www.cbhb.com.cn

（9）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（10）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，www.jjmmw.com

（12）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

网址：www.fund123.cn

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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

（20）北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

客户服务电话：400-819-6665

网址：www.buyforyou.com.cn

（21）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/

（22）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/)

（23）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

客户服务电话：400-618-0707

网址：<http://www.hongdianfund.com/>

（24）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：刘鹏宇

客户服务电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn/

（25）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/>

（26）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](https://www.ifastps.com.cn)

（27）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：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.hcjijin.com

（28）天津国美基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

客户服务热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

（29）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客户服务热线：400-921-7755

网址：www.leadbank.com.cn

（30）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客户服务热线：400-821-0203

网址：www.windmoney.com.cn

（31）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

客户服务热线：400-166-1188

网址：<http://www.jrj.com.cn/>

（32）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆
2105 室

法定代表人：袁顾明

客户服务热线：400-928-2266

网址：<https://www.dtfunds.com/>

（33）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 A 座 1504/1505 室。

法定代表人：张冠宇

客户服务热线：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

（34）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客户服务热线：4000-618518400-817-5666010-

网址：<https://danjuanapp.com/>

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代理销售本基金，并及时公告。

二、注册登记人

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

法定代表人：许会斌

联系人：郑文广

电话：010-66228888

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：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

四、审计基金资产的会计师事务所

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：许康玮、陈熹

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会 2011 年 12 月 28 日证监许可[2011]2130 号文核准。

二、基金类型

股票型。

三、基金的运作方式

契约型开放式。

四、基金存续期间

不定期。

五、基金的面值

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

六、募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

七、募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金自 2012 年 2 月 15 日至 2012 年 3 月 14 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七章第（一）条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。本基金的基金合同于 2012 年 3 月 16 日正式生效。

八、募集对象

指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

九、募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点向投资者公开发售。

具体募集场所见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

十、认购安排

1、认购时间：本基金向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、投资者认购应提交的文件和办理的手续：详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

3、认购原则和认购限额：认购以金额申请。投资者认购基金份额时，需

按销售机构规定的方式全额交付认购款项，投资者可以多次认购本基金份额，认购费率按累计金额计算。

代销网点每个基金账户每次认购金额不得低于 1000 元人民币，代销机构另有规定的，从其规定。直销机构每个基金账户首次认购金额不得低于 5 万元人民币，已在直销机构有认购本基金记录的投资者不受上述认购最低金额的限制，单笔追加认购最低金额为 1000 元人民币。当日的认购申请在销售机构规定的时间之后不得撤销。

十一、认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，具体费率结构如下表所示（M 代表累计认购金额）：

认购金额（M）	认购费率
M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	1000 元/笔

本基金认购费由认购人承担，可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

十二、认购份数的计算

认购本基金的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有，如基金合同生效，则折算为基金份额计入投资者的账户，具体份额以注册登记人的记录为准，投资者的总认购份额的计算方式如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期利息}) / \text{基金份额初始发售面值}$$

认购费用、认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

十三、认购的方法与确认

1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、认购确认

基金销售网点受理投资者的申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记人的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

十四、募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息，在基金合同生效后折算为基金份额归基金份额持有人所有，不收取认购费用。利息以注册登记人的记录为准。

计算结果按照四舍五入方式，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资人投资 10000 元认购本基金的基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额=10000/（1+1.2%）=9881.42 元

认购费用=10000-9881.42=118.58 元

认购份额=（9881.42+5）/1.00=9886.42 份

即投资人投资 10000 元认购本基金的基金份额，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 9886.42 份基金份额。

十五、募集资金

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。

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

十六、募集结果

截至 2012 年 3 月 14 日，基金募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为人民币 1,747,241,015.70 元。本次募集所有认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 199,428.66 元。本次募集有效认购户数为 16,541 户，按照每份基金份额初始面值人民币 1.00 元计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计 1,747,440,444.36 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次募集所有资金已全额划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的建信深证 100 指数增强基金托管专户。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

基金募集期届满，本基金具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

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

基金募集期内，本基金具备上述条件的，基金管理人可以决定停止基金发售，并按照规定办理验资和基金备案手续。

二、基金的备案

基金管理人应当自基金募集期届满之日或停止基金发售之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

三、基金合同的生效

1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效；

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。本基金的基金合同于 2012 年 3 月 16 日正式生效。

3、本基金募集期届满之日前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以注册登记人的记录为准。

四、基金募集失败的处理方式

基金募集期届满，未达到基金的备案条件，或因不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

五、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规另有规定的，按其规定办理。

六、基金合同生效

本基金的基金合同于 2012 年 3 月 16 日正式生效。

第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括本基金管理人和本基金管理人委托的代销机构。

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。销售机构名单和联系方式见上述第五章第一条。

基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。

二、申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

在基金开放日，投资者提出的申购、赎回申请时间应在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间（目前为下午 3:00）之前，其基金份额申购、赎回的价格为当日的价格；如果投资人提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间之后，其基金份额申购、赎回的价格为下一开放日的价格。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并提前公告，同时报中国证监会备案。

2、申购与赎回的开始时间

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间起开始办理申购。

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间起开始办理赎回。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日的 2 日前在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

本基金已于 2012 年 4 月 17 日起开始办理日常申购、赎回业务。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理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”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在交易时间结束前撤销，在交易时间结束后不得撤销；

4、先进先出原则，即在基金份额持有人赎回基金份额、基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、基金管理人在不影响基金份额持有人实质利益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购与赎回申请的确认

本基金注册登记人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日起到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购时，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无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照基金合同有关条款处理。

五、申购与赎回的数额限制

1、本基金代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为 10 元人民币，代销

机构另有规定的，从其规定；本公司直销柜台每个基金账户首次、单笔申购最低金额均为 10 元人民币；通过本公司网上交易申购本基金时，申购、定投最低金额均为 10 元人民币。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 10 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可根据市场情况，调整申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，基金管理人必须在调整的 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体上和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

六、申购费率与赎回费率

1、本基金申购费率随申购金额的增加而递减。具体费率如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	每笔 1,000 元

2、本基金赎回费率随申请份额持有期限增加而递减。具体如下表所示：

持有期限（Y）	赎回费率
Y < 1 年	0.5%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
Y ≥ 2 年	0

注：1 年指 365 天。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规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的 2 日前在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

七、申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），

投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

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

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

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

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 46915.31 份基金份额。

2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.148 = 11480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11480 - 57.40 = 11422.60 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

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，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

八、申购与赎回的注册登记

1、投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可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，并最迟于开始实施 2 日前在至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人网站上予以公告。

九、巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10% 的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占当日该基金赎回及转出申请总量的比例，确定单个账户当日办理的赎回或转出份额；未受理部分，除基金

份额持有人在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内编制临时报告书予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

3、暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

十、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资人的申购申请；

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

（3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（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，或其他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的情形；

（5）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他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（1）、（2）、（3）、（4）项情形时，基金管理人应根据有关规定在指定媒体上及基金管理人网站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。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

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

（3）连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，根据基金合同规定，基金管理人可以暂停接受赎回申请的情况；

（4）发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

（5）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案并予以公告。

已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法予以支付。

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。

3、暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

（1）如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值；

（2）如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值；

（3）如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

十一、基金转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的、已开通基金转换业务的其它开放式基金份额的行为。基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率届时在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天至少在一种中国证监会指定媒体上刊登公告并按有关规定报中国证监会备案。

十二、定期定额投资计划

定期定额投资计划，是指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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者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。

在各项条件成熟的情况下，本基金可为投资人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以招募说明书或基金管理人届时公布的业务规则为准。

十三、基金的非交易过户

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行，以及基金注册登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

（1）“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。

（2）“捐赠”仅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其他具有社会公益性质的社会团体。

（3）“司法强制执行”是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理。

3、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照其业务规则规定的标准收取转托管费。

十四、基金的销售

本基金的销售业务指接受投资人申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换等业务。

本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托代销机构办理本基金认购、申购、赎回等销售业务的，应与代销机构签订代销协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等销售事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

十五、基金份额的冻结、解冻及质押

1、基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

2、在有关法律法规有明确规定的情况下，本基金将可以办理基金份额的质押业务或其他业务。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对深证 100 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

三、投资理念

本基金以跟踪深证 100 指数为主，适度增强投资为辅，力求对标的指数的超越，使投资者分享中国经济增长和中国证券市场发展带来的良好收益。

四、投资策略

本基金采用指数增强型投资策略，以深证 100 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，在控制与比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

（一）资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制与目标指数的跟踪误差

的前提下，力争获得与所承担的主动风险相匹配的超额收益。

（二）股票投资组合策略

本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。

1、指数增强策略

（1）成份股权重优化增强策略。本基金在严格控制跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，进行宏微观经济研究，综合运用 GARP 策略、建信多因子选股模型等量化投资技术，深入分析成份股的估值水平、公司业绩增长情况、资产盈利水平和财务状况及股票市场交易情况等，在考虑交易成本、流动性、投资比例限制等因素并结合基金管理人对市场研判后，将适度超配价值被低估的正超额收益预期的成份股以及低配或剔除价值被高估的负超额收益预期的成份股。

（2）非成份股优选增强策略。本基金将依托公司投研团队的研究成果，综合采用数量化投资技术和深入调查研究相结合的研究方法，自下而上精选部分成份股以外的股票作为增强股票库，力争在最佳时机选择增强股票库中估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置，以获取超额收益。

1) 行业精选

各行业之间的预期收益、风险及其相关性是制定行业配置决策时的根本因素，本基金通过对各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、上市公司代表性、行业整体相对估值水平等因素或指标的综合评估，精选行业景气周期处于拐点或者行业景气度处于上升阶段的相关产业，在行业内部进行个股选择。

2) 个股精选

A、价值分析

价值分析包括公司的品质分析及估值水平分析。健康的品质是公司未来持续成长的良好基础，也可以提高公司的抗风险能力，因此本基金对上市公司的价值分析首先将分析公司的品质，着重对公司进行财务分析，考察每股收益率（EPS）、净资产收益率（ROE）、市盈率（PE）、市净率（PB）、市销率（PS）等指标，另外将根据上市公司所处行业景气度及其在行业中的竞争地位

等多方面的因素进行综合评估，挖掘上市公司的投资价值。

B、成长性分析

对于成长性分析，本基金将重点关注企业的持续增长潜力，对公司内部因素进行深刻理解和分析，挖掘上市公司保持高成长性和业绩增长的驱动因素（如公司治理结构、商业盈利模式、核心竞争力等），深入分析这些驱动因素是否具有可持续性，从而优选出竞争力优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。本基金选取的成长性指标主要包括：销售收入增长率、每股收益增长率、净利润增长率、主营业务增长率、PEG 等。

（3）其他增强策略。本基金将及时把握一级市场新股申购、增发或配股在內的盈利机会，提升投资组合的有效性。

2、组合调整策略

（1）定期调整

本基金将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整，达到有效控制跟踪偏离度和跟踪误差的目的。

（2）不定期调整

A. 与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配、各类限售股获得流通权等原因而需要进行成份股权重调整时，本基金将参考标的指数最新权重比例，进行相应调整。

B. 限制性调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

C. 根据申购和赎回情况调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D. 其他调整

根据法律、法规和基金合同的规定，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，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调

整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

3、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金为指数增强型基金，将通过适度的主动投资获取超越标的指数的超额收益，同时也将因承担相应的主动风险而导致较大的跟踪误差。

因此，本基金将每日跟踪基金组合与指数表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案，实现有效控制跟踪误差。

（三）债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下管理策略：

1、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

2、收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3、债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取适当的超额收益。

4、个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

（四）权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

（五）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（六）其他金融衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

五、投资管理程序

1、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

（2）宏观经济发展环境、证券市场走势。

2、投资管理程序

（1）研究分析

研究部依托公司研究平台，整合外部信息及外部研究力量的研究成果进行指数跟踪、成份股公司及非成份股公司行为等信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策

投资决策委员会根据法律法规、基金合同、研究报告以及基金监控指标和调整指标等，召开投资决策会议，确定基金投资组合是否需要进行调整以更好地跟踪标的指数，审批总体投资方案及重大投资事项。

基金经理根据标的指数，结合研究报告，构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将根据投资决策委员会确定的投资组合调整方案采取适

当的方法调整组合，以降低交易成本、控制投资风险，同时适当进行增强投资。对于超出权限范围的投资，基金经理按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

（3）交易执行

交易部接收到基金经理下达的交易指令后，首先应对指令予以审核，然后具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

（4）投资回顾

风险管理部定期对基金的绩效进行评估，并对基金的跟踪误差、跟踪偏离度、信息比率、流动性风险等进行评估。同时，评估信息将以绩效评估报告的形式及时反馈至投资决策委员会、监察稽核部、投资管理部等相关部门，为制定和调整投资策略、评估风险水平提供依据。

六、业绩比较基准

$95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

深证 100 指数是中国证券市场第一只定位投资功能和代表多层次市场体系的指数。由深圳证券交易所委托深圳证券信息公司编制维护，此指数包含了深圳市场 A 股流通市值最大、成交最活跃的 100 只成份股。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序，并在报中国证监会备案后，可以变更业绩比较基准并及时公告。

七、风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

八、投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- (3) 本基金投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- (4) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- (7) 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%；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%；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%。其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

（8）本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（9）法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

鉴于本基金为指数增强型基金，本基金按照标的指数的构成比例进行投资的部分不计入第（2）项规定的限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第（3）项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

九、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

十、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 17 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 2017 年 6 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	96,479,163.87	90.43
	其中：股票	96,479,163.87	90.43
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	9,112,376.05	8.54
8	其他资产	1,095,734.25	1.03
9	合计	106,687,274.17	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,147,760.32	2.06
B	采矿业	973,470.00	0.93
C	制造业	43,468,162.09	41.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,577,200.00	1.51
F	批发和零售业	1,426,500.00	1.37
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	5,211,643.87	5.00
J	金融业	11,543,795.30	11.07
K	房地产业	3,509,003.24	3.37
L	租赁和商务服务业	5,504.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,693,397.00	1.62
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	1,972,356.00	1.89
S	综合	-	-

	合计	73,528,791.82	70.53
--	----	---------------	-------

注：以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

（2）报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,298,394.00	1.25
B	采掘业	209,264.00	0.20
C	制造业	13,872,665.76	13.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	288,885.24	0.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,923,460.00	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	42,528.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,093,215.40	2.97
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,754,821.65	1.68
L	租赁和商务服务业	242,540.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	224,598.00	0.22
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	22,950,372.05	22.01

注：以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

（3）报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

（1）期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票

投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	171,354	7,054,644.18	6.77
2	000333	美的集团	131,887	5,676,416.48	5.44
3	000725	京东方 A	1,102,700	4,587,232.00	4.40
4	002304	洋河股份	37,500	3,255,375.00	3.12
5	000776	广发证券	178,470	3,078,607.50	2.95
6	000858	五粮液	52,293	2,910,628.38	2.79
7	002007	华兰生物	76,000	2,774,000.00	2.66
8	002065	东华软件	127,046	2,768,332.34	2.66
9	002415	海康威视	83,603	2,700,376.90	2.59
10	002456	欧菲光	147,200	2,674,624.00	2.57

(2) 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	002092	中泰化学	160,100	2,033,270.00	1.95
2	601238	广汽集团	69,200	1,803,352.00	1.73
3	000517	荣安地产	377,381	1,754,821.65	1.68
4	002589	瑞康医药	103,300	1,590,820.00	1.53
5	300136	信维通信	39,400	1,576,788.00	1.51

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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

（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。

（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。

（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

（1）本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，广发证券股份有限公司（000776）于 2016 年 11 月 28 日发布公告称 11 月 26 日收到中国证监会行政处罚决定书：2015 年 1 月 16 日，中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到责令限期改正的行政监管措施。2015 年 8 月 24 日，收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（鄂证调查字 2015023 号）。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2015 年 9 月 12 日，因在接入恒生 HOMES 系统期间未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，因此受到中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款等处罚。

（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。

（3）其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	14,626.03

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,938.79
5	应收申购款	1,077,169.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,095,734.25

（4）本报告期末本基金持有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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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不存在流通受限情况。

2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2017 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012 年 3 月 16 日—— 2012 年 12 月 31 日	-10.30%	1.19%	-9.18%	1.29%	-1.12%	-0.10%
2013 年 1 月 1 日—— 2013 年 12 月 31 日	-1.65%	1.32%	-4.53%	1.35%	2.88%	-0.03%
2014 年 1 月 1 日—— 2014 年 12 月 31 日	37.77%	1.13%	30.59%	1.15%	7.18%	-0.02%
2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日	30.15%	2.68%	21.11%	2.46%	9.04%	0.22%
2016 年 1 月 1 日— 2016 年 12 月 31 日	-13.40%	1.81%	-15.64%	1.57%	2.24%	0.24%
2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日	16.77%	0.79%	12.18%	0.79%	4.59%	0.00%
自基金合同生效起—— 2017 年 6 月 30 日	59.97%	1.68%	29.78%	1.58%	30.19%	0.10%

第十一部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

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

二、基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立本基金的银行存款托管账户；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基金结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记人自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

四、基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管

人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

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

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十二部分 基金资产的估值

一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

二、估值日

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

三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产和负债。

四、估值方法

（一）股票估值方法

1、上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、未上市股票的估值：

（1）首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（2）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第（1）条确定的估值价格进行估值。

（3）送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第（1）条确定的估值价格进行估值。

（4）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、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（二）债券估值方法

1、在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。

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

4、在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（三）权证估值方法

1、上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

3、停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4、因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

5、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（四）资产支持证券的估值方法

1、在交易所上市交易的资产支持证券，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、全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（五）其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

（六）在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。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。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以

电子或者加盖公章的书面形式加密发送至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章或者以电子签名确认的方式返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

七、基金份额净值的计算

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金总份额余额

基金份额净值的计算，精确到小数点后 4 位，小数点第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个市场交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。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、基金份额净值和基金累计份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在中国证监会指定媒体上。

八、估值错误的处理

1、当基金资产的估值或基金份额净值计价错误导致基金份额净值小数点后 4 位内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，进行公告，并报中国证监会备案。

2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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

3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人对基金份额持有人或基金先行支付赔偿金。基金管理人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人及托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿，追偿过程中产生的有关费用应列入基金费用，从基金资产中列支；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（5）基金管理人及基金托管人计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，进行公告，并报中国证监会备案。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款第 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。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，

基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十三部分 基金的收益分配

一、收益的构成

在本基金基金合同项下，基金收益即基金利润是指基金利息收入、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收益减去公允价值变动收益后的余额，因运用基金财产带来的成本或费用的节约也计入收益。

二、基金可供分配利润

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

三、收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金方式；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

五、收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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

六、收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记人可以将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

第十四部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、基金银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

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

本基金的管理费率为年费率 1.0%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.2%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、标的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本《基金合同》生效之日起开始计提，每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

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

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计提，逐日累计，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

4、本条第一款第 4 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

四、基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

五、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

六、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十五部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

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

二、基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、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和基金托管人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通知基金托管人，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后在 2 日内在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

第十六部分 基金的信息披露

一、披露原则

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。

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报刊和网站披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺在公开披露基金信息的过程中不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

二、基金募集信息披露

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

2、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体上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

4、基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上，更新内容截至每六个月的最后一日。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

三、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

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

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

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

4、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。

5、基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，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。

四、基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在中国证监会指定媒体上公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在中国证监会指定媒体上。

五、临时报告与公告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金代销机构；
- 20、更换基金注册登记人；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

六、澄清公告

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

七、中国证监会规定的其他信息

八、信息披露文件的存放与查阅

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

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

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第十七部分 风险揭示

基金风险即基金收益的不确定性，所有可能影响基金业绩的因素都属于风险的来源，而风险管理本质上就是在一定约束条件下对预期收益和预期风险的平衡。科学严谨的风险管理对基金投资管理绩效至关重要，与投资者利益休戚相关，因此对风险的识别、评估和控制应贯穿基金投资的全过程。本基金风险按来源划分，主要包括系统性风险、非系统性风险、流动性风险、基金管理风险以及本基金的特定风险。

一、系统性风险

系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对股票债券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险，经济周期风险，利率风险，购买力风险等因素。

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场及债券市场的价格和收益率产生变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及拟投资上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

5、汇率风险

汇率的变动可能会影响基金投资标的的价格和基金资产的实际购买力。

6、其他风险

因战争、自然灾害等不可抗力产生的风险。

二、非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险及债券发行人的信用风险等。拟投资上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等都会导致上市公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使基金投资收益下降。基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险。

三、基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括管理风险、交易风险、流动性风险、运营风险及道德风险。

1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准从而影响基金收益水平。对主要业务人员如基金经理的依赖也可能产生管理风险。

2、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误，或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门，导致基金利益的直接损失。

3、流动性风险

在市场或者个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多所导致的收益下降风险。

4、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障或瘫痪等情况而无法完成基金的申购、赎回、注册登记、清算交收等指令而产生的操作风险，或者由于操作过程效率低下或人为疏忽和错误而产生的操作风险。

5、道德风险

是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

四、本基金的特定风险

（一）被动跟踪指数的风险

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、替代投资风险

在某些情况下（包括指数成份股投资受限制、市场流动性不足等）导致本基金无法投资或者获得足够数量的某种或几种股票时，基金管理人将运用替代投资策略，如买入同行业指数成份股、备选成份股或非成份股等，力求降低基金跟踪偏离度，但无法消除由此引起的基金收益率与业绩比较基准之间的偏离及相应的风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

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

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

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

（6）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的

现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（二）主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

五、其他风险

主要是由其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等有可能导致基金财产损失或影响基金收益水平。

第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

1、基金合同变更涉及基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

2、除上述第 1 项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

二、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

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

三、基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

3、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 基金清算组做出清算报告；
- (6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金清算公告；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付基金财产清算费用；
- (2) 缴纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

第十九部分 基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

1、基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开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、注册登记人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9）法律法规、基金合同规定的其它权利。

3、基金份额持有人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- （3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- （5）执行生效的基金份额持有人大会决议；
- （6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

（7）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、义务

1、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定获得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；

（5）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

（6）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

（7）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人；

（8）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（9）自行承担基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

（10）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

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

（12）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

（13）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

（14）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（15）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

（16）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；

（17）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（18）法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

（6）配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

（7）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资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

（8）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

（9）接受基金托管人依法进行的监督；

（10）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

（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，应予以保密，不得向他人泄露；

（13）按基金合同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）按照法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回等申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

（15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（17）按规定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不少于 15 年；

（18）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（19）编制季度、半年度和年度基金报告；

（20）确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，能在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

（22）面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（23）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（24）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，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（25）不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

（26）公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；

（27）以基金管理人的名义，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；

（28）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不以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) 按规定保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (8) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

（9）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

（10）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（12）按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等不少于 15 年；

（13）根据有关法律法规，从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（17）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（18）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（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，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

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

（22）不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

（23）法律、法规、基金合同所规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人共同组

成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

（二）有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、更换基金托管人；
- 4、更换基金管理人；
- 5、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 6、本基金与其它基金的合并；
- 7、变更基金类别；
- 8、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 9、变更基金份额持有人大会程序；
- 10、对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 11、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费、基金托管费；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内调整申购费率、调低赎回费率及变更收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

（四）召集人和召集方式

- 1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。
- 2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人

提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（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。

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

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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。

（五）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，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体及基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- （6）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理

有效期限等)、送达时间和地点;

- (7) 表决方式;
- (8) 会务常设联系人姓名、电话;
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式及截止时间。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票结果。

(六) 基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

B. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证

明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

B. 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和统计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；

C. 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

D. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和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和授权委托书、身份证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额

10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

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

A. 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

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

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

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的

情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(八) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

(1) 特别决议

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

(2) 一般决议

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

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

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

6、基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托

管人均有约束力。

（九）计票

1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，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。

（十）基金份额持有人大会决议的生效与公告

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内由相关信息披露义务人

在至少一种指定媒体公告。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金方式；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（三）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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

（四）收益分配中发生的费用

收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记人可以将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、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、标的指数使用费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、基金银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

（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

本基金的管理费率为年费率 1.0%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.2%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、标的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本《基金合同》生效之日起开始计提，每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

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

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计提，逐日累计，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

4、本条第 1 款第（4）至第（9）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

（五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对深证 100 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

（三）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

2、基金投资组合比例限制

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

（3）本基金投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

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

（5）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（6）在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（7）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%；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%；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%。其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

（8）本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（9）法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

鉴于本基金为指数增强型基金，本基金按照标的指数的构成比例进行投资的部分不计入第（2）项规定的限制。

法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第 3）项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

（四）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值指基金资产总值减去基金负债后的价值；

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金总份额余额

基金份额净值的计算，精确到小数点后 4 位，小数点第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、每个市场交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。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、基金份额净值和基金累计份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在中国证监会指定媒体上。

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、基金合同变更涉及基金合同第八节第二项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

2、除上述第 1 项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

3、清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）基金清算组做出清算报告；

（6）会计师事务所对清算报告进行审计；

（7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（8）将基金清算结果报告中国证监会；

（9）公布基金清算公告；

（10）对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- （1）支付基金财产清算费用；
- （2）缴纳基金所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

八、争议解决方式

1、基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交设在上海的中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十部分 基金托管协议的内容摘要

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

住所：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

成立时间：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158 号

文

注册资本：2 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售，资产管理和中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：010-66228888

传真：010-66228889

联系人：路彩营

（二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987]40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：人民币 742.62 亿元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

（3）本基金投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

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

（5）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（6）在全国银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（7）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%；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%；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%。其他权证投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定。

（8）本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券

投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

（9）本基金持有一家上市公司发行证券时明确规定的锁定期在三个月以上的流通受限证券，其市值不超过基金资产净值的百分之四；本基金持有所有上市公司发行证券时明确规定的锁定期在三个月以上流通受限证券，其市值不超过基金资产净值的百分之六；本基金持有所有上市公司发行证券时明确规定的锁定期在三个月以内（含三个月）的流通受限证券，其市值不超过基金资产净值的百分之十五。经基金管理人和基金托管人协商，履行适当程序后可对以上比例进行调整；

（10）法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

鉴于本基金为指数增强型基金，本基金按照标的指数的构成比例进行投资的部分不计入第（2）项规定的限制。

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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改其投资组合限制规定。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当

程序后可不受上述规定的限制。根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后 2 个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

（1）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

（2）基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（3）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（4）基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行

证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。

（3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（4）基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（5）基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7、基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资其他方面进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、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。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

（三）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,在规

定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

三、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对于基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，

同时通知基金托管人在限期内纠正。

四、基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

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

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

2、基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

3、基金的银行存款账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，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存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

（5）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算

办法》以及监督银行业管理机构的其他规定。

4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

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即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

5、债券托管账户的开立和管理

(1) 募集资金经验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 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，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、其他账户的开立和管理

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，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库。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。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按

照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算与复核

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人就基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）未上市股票的估值：

A. 首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

B. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一种股票以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

C. 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一种股票以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

D. 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）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行

机构发生了影响证券价格的重大事件的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。

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

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值方法

(1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、资产支持证券的估值方法

(1) 在交易所上市交易的资产支持证券，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) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

（6）在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。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。

（二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人根据基金合同约定对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。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、如采用托管协议第八条“基金资产净值计算和会计核算”中估值方法的第（1）—（5）进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，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，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

2、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，基金托管人不负赔偿责任；

3、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。

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

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的

前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

（三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（四）基金账册的建立

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

（五）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。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。

（六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备

有权机构对相关文件审核检查。

六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权利登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关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，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

八、托管协议的变更与终止

1、基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。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。修改后的新协议，应报中国证监会核准。

2、基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

第二十一部分 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）

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五，9：00~17：00 的人工电话咨询服务。

3、客户留言服务

投资人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定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）

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：投资人可通过网上“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；同时投资人还可通过“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地下载各类直销表单。

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，帮助客户更好地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，可将投资人的疑问、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

若投资人准确完整地预留了手机号码（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人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

为保证投资人账户信息安全，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

投资人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。

第二十二部分 其他应披露事项

自 2017 年 3 月 16 日至 2017 年 9 月 15 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。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增上海基煜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	2017-09-01
2	建信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷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	2017-06-12
3	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017-04-24
4	关于新增华融证券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	2017-04-20
5	关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017-03-31

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 查阅上述公告。

第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十四部分 备查文件

- 1、中国证监会核准建信深证 100 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、关于申请募集建信深证 100 指数增强型证券投资基金之法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

本页无正文，为《建信深证 100 指数增强型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
二〇一七年十月十七日