

# 中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证 券投资基金更新招募说明书

(2021 年第 1 号)

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二零二一年二月

## 重要提示

中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请于 2018 年 6 月 22 日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1017 号《关于准予中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金注册的批复》注册,并于 2019 年 1 月 25 日经中国证监会证券基金机构监管部部函[2019]234 号《关于中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,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投资价值、收益及市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场及期货市场,基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动,基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、其他风险等。本基金为股票指数型证券投资基金,预期风险与预期收益高于混合型证券投资基金、债券型基金与货币市场基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资于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、债券、货币市场工具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),在政策市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下,如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能遇见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击,发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金可以投资资产支持证券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险等。本基金可以投资股指期货，投资股指期货的主要风险包括流动性风险、期货基差风险、期货合约展期风险、期货交割风险、期货保证金不足风险、衍生品杠杆风险、对手方风险、平仓风险、无法平仓风险等。本基金可以投资流通受限证券，可能存在流动性风险、法律风险和操作风险。本基金可投资科创板股票，科创板股票的主要风险包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、监管规则及政策变化风险等。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：流动性风险，面临大额赎回时可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿以及借券费用的风险；市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。此外，本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，标的指数成份券调整、成份券配股、增发、停牌、交易成本的存在等原因均有可能导致基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，从而影响跟踪误差。本基金的投资范围包括存托凭证，除面临与其他投资沪深市场股票的基金共同的风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险。

本基金是发起式基金，在基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，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，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金基金份额分为 A、C 两类，其中 A 类基金份额收取认/申购费，不计提销售服务费；C 类基金份额不收取认/申购费，但计提销售服务费；A、C 两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资有风险，投资人认/申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为 2021 年 1 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

。

## 目 录

重要提示 .....	1
第一部分 绪言 .....	5
第二部分 释义 .....	6
第三部分 基金管理人 .....	12
第四部分 基金托管人 .....	21
第五部分 相关服务机构 .....	27
第六部分 基金的募集 .....	34
第七部分 基金合同的生效 .....	35
第八部分 基金份额的申购与赎回 .....	36
第九部分 基金的投资 .....	50
第十部分 基金的业绩 .....	64
第十一部分 基金的财产 .....	65
第十二部分 基金资产的估值 .....	66
第十三部分 基金的收益分配 .....	73
第十四部分 基金的费用与税收 .....	75
第十五部分 基金的会计与审计 .....	79
第十六部分 基金的信息披露 .....	80
第十七部分 风险揭示 .....	88
第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算 .....	98
第十九部分 基金合同的内容摘要 .....	101
第二十部分 托管协议的内容摘要 .....	102
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	103
第二十二部分 其他应披露事项 .....	105
第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式 .....	108
第二十四部分 备查文件 .....	109
附件 1: 基金合同的内容摘要 .....	110
附件 2、托管协议的内容摘要 .....	127

## 第一部分 绪言

《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)以及《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金(以下简称“基金”或“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合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,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,应详细查阅基金的基金合同。

## 第二部分 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：指中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指中金基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》：指《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式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
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数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、《招募说明书》或本招募说明书：指《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、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
- 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，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，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、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日

实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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

13、《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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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

21、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、基金管理人的高级管理人员或基金经理等人员的资金

22、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等人员

23、投资人或投资者：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

24、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

25、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、转托管及定期定额投资等业务

26、销售机构：指中金基金管理有限公司以及符合《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，办理基金销售业务的机构

27、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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中金基金管理有限公司或接受中金基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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、转托管及定期定额投资等业务导致的基金份额变动及结余情况的账户

31、标的指数：指 MSCI 中国 A 股国际价值指数

32、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

33、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

34、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

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、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

38、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

39、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

40、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

41、《业务规则》：指《中金基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

42、认购：指在基金募集期内，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

43、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

44、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

45、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

46、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

47、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受理基金申购申请的一种投资方式

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(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的 10%

49、元：指人民币元

50、基金收益：指基金投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、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

51、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、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总数

54、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

55、A 类基金份额：指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时收取根据持有期限收取赎回费用，而不从基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

57、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

58、摆动定价机制：指当本基金各类份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

59、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

60、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

61、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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：中金基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

法定代表人：胡长生

成立时间：2014 年 2 月 10 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可〔2014〕97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：4 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：张显

联系电话：010-63211122

公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

胡长生先生，董事长，经济学博士。1998 年 12 月至 2005 年 12 月就职于中国证监会，历任政策研究室综合处副处长、规划发展委员会委员（正处级）、机构监管部调研员、深圳专员办处长；2005 年 12 月至 2011 年 11 月就职于中央汇金投资有限责任公司，历任资本市场部副主任、主任，非银行部资深业务主管及资本市场处主任；2011 年 11 月至 2020 年 11 月就职于中国中金财富证券有限公司（原中国中投证券有限责任公司），历任副董事长、总裁、执行委员会

副主任、执行委员会主任。现任中国国际金融股份有限公司管理委员会成员。

黄劲峰先生，董事，机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所（英国及香港）审计、核算见习生、副经理，经理等职务；香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务；高盛（亚洲），高盛集团（日本东京）固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务；北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位；高盛（亚洲）有限责任公司资产管理部亚太区首席营运官、亚太（除日本）首席营运官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、管理委员会成员。

徐翌成先生，董事，金融学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部收购兼并和财务顾问组负责人；总裁助理、战略发展部负责人；董事会秘书、综合办公室、战略发展部负责人。现任中国国际金融股份有限公司总裁助理、资产管理板块负责人。

孙菁女士，董事，管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

赵璧先生，董事，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理；中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理、创新投资管理部负责人。

汤琰女士，董事，管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理；华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

冒大卫先生，独立董事，哲学博士，历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记，北京大学医学部副主任、财务部部长，北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司董事、总裁，北京神州泰岳智能数据技术有限公司董事长，东莞市星晨信息技术有限公司监事，三亚迈普乐科技有限公司董事，北京新媒传信科技有限公司执行董事，北京启天同信科技有限公司董事，北京科兴生物制品有限公司董事，鼎富智能科技有限公司董事长。

王元先生，独立董事，法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师事务所、北京市嘉源律师事务所上海分所律师。现任北京市嘉源律师事务所高级合伙人、管委会成员，兼任上海思华科技股份有限公司独立董事。

江勇先生，独立董事，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部执行总经理、董事总经理，公司管理委员会成员，顾问董事。现任中国国际金融美国证券有限公司外部管理顾问。

## 2、基金管理人监事

白娜女士，执行监事，管理学硕士。历任航天信息股份有限公司内审部审计主管；长盛基金管理有限公司基金会计；中国国际金融股份有限公司资产管理部高级经理。现任中金基金管理有限公司基金运营部负责人。

## 3、基金管理人高级管理人员

胡长生先生，董事长。简历同上。

孙菁女士，总经理。简历同上。

汤琰女士，副总经理。简历同上。

邱延冰先生，经济学博士。历任国家外汇管理局中央外汇业务中心战略研究处研究员，投资一处投资经理，投资二处副处长、处长（期间外派香港华安投资有限公司，担任副总经理兼投资总监）；丝路基金有限责任公司投资决策委员会委员、研究部副总监（主持工作）；和泰人寿保险股份有限公司总经理助理（兼资产管理部总经理）、董事会秘书。现任中金基金管理有限公司副总经理、基金经理。

李虹女士，督察长，法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师；中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

夏静女士，理学硕士。历任普华永道（深圳）咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务部经理；中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司首席信息官、风险管理部负责人。

## 4、本基金基金经理

刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量

化研究员。2017 年 4 月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理。管理的公募基金包括：2017 年 8 月 2 日至今担任中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2020 年 10 月 22 日至今担任中金 MSCI 中国 A 股国际质量指数发起式证券投资基金基金经理，2020 年 11 月 6 日至今担任中金 MSCI 中国 A 股国际低波动指数发起式证券投资基金、中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金、中金 MSCI 中国 A 股国际红利指数发起式证券投资基金基金经理；2017 年 8 月 2 日至 2018 年 11 月 13 日担任中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 8 月 2 日至 2018 年 11 月 15 日担任中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金离任基金经理情况：朱宝臣先生，管理时间为 2019 年 1 月 25 日至 2020 年 11 月 6 日。

#### 5、投资决策委员会成员

孙菁女士，管理学硕士。简历同上。

赵璧先生，经济学硕士。简历同上。

邱延冰先生，经济学博士。简历同上。

石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员；天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员；中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016 年 7 月加入中金基金管理有限公司，现任传统投资部基金经理。

朱宝臣先生，理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017 年 10 月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资团队负责人。

董珊珊女士，工商管理硕士。历任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理、投资经理，现任中金基金管理有限公司传统投资部基金经理。

6、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、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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，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、法律法规和中国证监会规定的或基金合同约定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺

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

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7) 玩忽职守, 不按照规定履行职责;

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反基金合同行为的发生;

4、基金管理人承诺加强人员管理, 强化职业操守, 督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范, 诚实信用、勤勉尽责;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

## **五、基金经理承诺**

1、依照有关法律法规和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## **六、基金管理人的内部控制制度**

1、本基金管理人高度重视内部风险控制, 建立了完善的风险管理体系和控制体系, 从制度上保障本基金的规范运作。

公司内部控制的总体目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律、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风格;

(2) 防范和化解经营风险, 提高经营管理效率, 确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整, 实现公司的持续、稳定、健康发展;

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

## 2、公司内部控制遵守以下原则

(1) 首要性原则：公司将内部控制工作作为公司经营中的首要任务，以保障公司业务的持续、稳定发展；

(2) 健全性原则：内部控制工作必须覆盖公司的所有业务部门和岗位，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各项经营业务流程与环节；

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

(4) 独立性原则：公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立性；

(5) 相互制约原则：公司内部各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；

(6) 防火墙原则：基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，严格分离，分别核算；

(7) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内控效果，保证公司经营管理和基金投资运作符合行业最佳操守；

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

(9) 全面性原则：内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

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

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

## 3、公司内部控制的体系

### (1) 组织架构

公司实行董事会领导下的总经理负责制，建立以客户服务为核心的业务组织架构，依据战略规划和公司发展需要，对各部门进行创设与调整，强调各部门之

间合理分工、互相衔接、互相监督。

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、风险管理委员会、产品委员会等专业委员会，分别负责基金投资、风险管理、产品相关的重大决策。

公司根据独立性与相互制约、相互衔接原则，在精简的基础上设立满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位。各机构、各部门必须在分工合作的基础上，明确各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制、严格的操作程序和合理的工作标准，使各项工作规范化、程序化，有效防范和应对可能存在的风险。

## （2）内控流程

内部控制流程分为事前防范、事中监控与事后完善三个步骤。

1) 事前防范主要是指内部控制的相关责任部门与责任人依照内部控制的原则，针对本部门 and 岗位可能发生的风险制定相应的制度和技术防范措施；

2) 事中监控主要指内部控制的相关职能部门依照适用的制度和防范措施进行全面的监督与检查，降低风险发生的可能性。事中监控的重点在于实施例行和突击检查、定期与不定期检查以及专项检查与综合检查等；

3) 事后完善主要通过风险事件的分析与总结，使相关部门和岗位对自身的业务流程进行完善。

## 4、内部控制的主要内容

为确保公司内部控制目标的实现，公司对各环节的经营行为采取一定的控制措施，充分控制相应业务风险。主要包括如下方面：

- （1）投资管理业务控制；
- （2）市场推广及销售业务控制；
- （3）信息披露控制；
- （4）信息技术系统控制；
- （5）会计系统控制；
- （6）监察稽核控制等。

## 5、内部控制的监督

公司对内部控制的执行过程、效果以及适时性等进行持续的监督。

监察稽核部定期和不定期对公司的内部控制、重点项目进行检查和评价，出具监察稽核报告，报告报公司督察长、总经理。

必要时，公司股东、董事会、执行监事、总经理和督察长均可要求公司聘请外部专家就公司内控方面的问题进行检查和评价，并出具专题报告。外部专家可以是律师、注册会计师或相关方面具有专业知识的人士。

在出现新的市场情况、新的金融工具、新技术、新的法律法规等情况，有可能影响到公司基金投资、正常经营管理活动时，董事会下设的专业委员会对公司的内部控制进行全面的检查，审查其合法、合规和有效性。如果需要做出一定的调整，则按规定的程序对内部控制制度进行修订。

## 6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人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) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人不断发展完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：缪建民

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2020 年 9 月 30 日，本集团总资产 81,567.00 亿元人民币，高级法下资本充足率 16.19%，权重法下资本充足率 13.63%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队，

现有员工 100 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；

12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12 月荣获 2019 东方财富风云榜“2019 年度最佳托管银行”奖。2020 年 1 月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019 年度优秀资产托管机构”奖项；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10 月荣获《中国基金报》“2019 年度最佳基金托管银行”奖。

二、主要人员情况 缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。十九届中央候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991 年加入本行；2002 年 10 月至 2013 年 12 月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013 年 12 月至 2016 年 10 月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016 年 10 月至 2017 年 4 月任本行业务总监兼北京分行行长；2017 年 4 月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019 年 4 月起任本行副行长。

刘波先生，招商银行资产托管部总经理。硕士研究生毕业，1999 年 7 月加盟招商银行至今，历任招商银行重庆分行干部、总行计划财务部副经理、经理、



高级经理、总行资产负债管理部总经理助理、深圳分行党委委员、行长助理、副行长等职务，具有 20 余年银行从业经验，在资产负债管理、资本管理、资产证券化、统计分析、金融同业、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### 三、基金托管业务经营情况

截至 2020 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 690 只证券投资基金。

### 四、托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内部控制制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

#### 3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风

险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4) 有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

(5) 适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、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修订和完善。

(6) 防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险环节。

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(3) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，根据法律法规和其他有关规定调用资料，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(4) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护,对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等,保证信息技术系统的安全。

(5) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源管理。

### **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**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督,对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定,及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 直销柜台

名称: 中金基金管理有限公司

住所: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

法定代表人: 胡长生

电话: 010-63211122

传真: 010-66159121

联系人: 张显

客户服务电话: 400-868-1166

网站: [www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.com)

##### (2) 网上直销

交易系统: 中金基金网上交易系统

交易系统网址: [trade.ciccfund.com](http://trade.ciccfund.com)

#### 2、其他销售机构

##### (1) 包商银行股份有限公司

网址: <http://www.bsb.com.cn/>

电话: 95352

##### (2) 渤海银行股份有限公司

网站: [www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

电话: 95541

##### (3) 北京蛋卷基金销售有限公司

网址: [danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

电话: 400-061-8518

##### (4) 东方财富证券股份有限公司

网址: <http://www.18.cn>

电话: 95357

(5) 上海好买基金销售有限公司

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

电话: 400-700-9665

(6) 北京虹点基金销售有限公司

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

电话: 400-618-0707

(7) 北京汇成基金销售有限公司

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

电话: 400-619-9059

(8) 上海基煜基金销售有限公司

网站: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

电话: 400-820-5369

(9) 京东肯特瑞基金销售有限公司

网址: [kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

电话: 95118

(10) 上海联泰基金销售有限公司

网址: <http://www.66liantai.com/>

电话: 400-118-1188

(11) 上海陆金所基金销售有限公司

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

电话: 4008-219-031

(12) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

网址: <http://www.fund123.cn>

电话: 4000-766-123

(13) 平安银行股份有限公司

网站: [bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

电话: 95511

(14) 平安证券有限责任公司

网址: <http://stock.pingan.com>

电话: 95511-8

(15) 南京苏宁基金销售有限公司

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

电话: 95177

(16) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

网站: [www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

电话: 400-819-9868

(17) 腾安基金销售(深圳)有限公司

网址: <https://www.txfund.com/>

电话: 95017

(18) 上海天天基金销售有限公司

网址: <https://fund.eastmoney.com/>

电话: 95021

(19) 通华财富(上海)基金销售有限公司

网站: <https://www.tonghuafund.com>

电话: 95156转5

(20) 浙江同花顺基金销售有限公司

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

电话: 4008-773-772

(21) 上海挖财基金销售有限公司

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

电话: 021-50810673

(22) 阳光人寿保险股份有限公司

网址: [fund.sinosig.com](http://fund.sinosig.com)

电话: 95510

(23) 中国银河证券股份有限公司

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

电话: 4008-888-888 或 95551

(24) 珠海盈米基金销售有限公司

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

电话: 020-89629099

(25) 长城证券股份有限公司

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

电话: 95514

(26) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

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

电话: 400-820-2899

(27) 招商银行股份有限公司

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

电话: 95555

(28) 中国国际金融股份有限公司

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

电话: 010- 65051166

(29) 中国中金财富证券有限公司

网址: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

电话: 95532或400-600-8008

(30) 中泰证券股份有限公司

网址: <http://www.zts.com.cn/>

电话: 95538

(31) 中信建投证券股份有限公司

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

电话: 400-888-8108

(32) 中信证券股份有限公司

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

电话: 95548

(33) 中信证券(山东)有限责任公司

网址: <http://sd.citics.com/>

电话: 95548

(34) 中信期货有限公司

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

电话: 400-990-8826

(35) 中信证券华南股份有限公司

网址: <http://www.gzs.com.cn>

电话: 95396

(36) 中银国际证券股份有限公司

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

电话: 400-620-8888

(37) 上海万得基金销售有限公司

网址: <http://www.520fund.com.cn>

电话: 400-821-0203

(38) 万家财富基金销售(天津)有限公司

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

电话: 010-59013895

(39) 济安财富(北京)基金销售有限公司

网址: <http://www.jianfortune.com>

电话: 400-673-7010

(40) 安信证券股份有限公司

网址: <http://www.essence.com.cn>

电话: 95517

(41) 江苏汇林保大基金销售有限公司

网址: <http://www.huilinbd.com>



电话: 025-66046166

(42) 中邮证券有限责任公司

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

电话: 400-888-8005

(43) 海通证券股份有限公司

网址: <http://www.htsec.com>

电话: 95553

(44) 华鑫证券有限责任公司

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

电话: 95323

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

## 二、登记机构

名称: 中金基金管理有限公司

住所: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

法定代表人: 胡长生

电话: 010-63211122

传真: 010-66155573

联系人: 白娜

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 韩炯

电话: 021 - 31358666

传真：021 - 31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：陆奇

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层

办公地址：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

签章注册会计师：奚霞、丁时杰

联系人：程海良

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集申请于 2018 年 6 月 22 日经中国证监会证监许可[2018]1017 号文《关于准予中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金注册的批复》注册。

本基金募集期自 2018 年 12 月 21 日至 2019 年 1 月 22 日止，共募集 10,561,944.88 份，有效认购户数 57 户。

本基金的基金类型为股票型证券投资基金，运作方式为契约型开放式，存续期限为不定期。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效时间

本基金的基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止并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。若届时的法律法规或证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或证监会规定执行。

《基金合同》生效满三年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不超过 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。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。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行基金份额的申购与赎回。具体办法由基金管理人或相关销售机构另行公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2019 年 2 月 22 日起开放日常申购赎回业务。

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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份

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、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间结束前撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销;

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

5、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内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、赎回申请不成立。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流

程时，赎回款项顺延至上述影响因素消除之日的下一个工作日划出。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 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，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时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。若申购未生效，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。

4、基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

## 五、申购与赎回的数量限制

1、通过基金管理人的直销柜台进行申购，单个基金账户首次申购最低金额为 100 元（含申购费），追加申购最低金额为单笔 100 元（含申购费）。

2、通过基金管理人网上直销进行申购，单个基金账户首次最低申购金额为 100 元（含申购费），追加申购最低金额为单笔 100 元（含申购费），网上直销单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

3、通过本基金其他销售机构进行申购，首次申购最低金额为人民币 1000 元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔 500 元（含申购费）；各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、投资人将持有的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

5、基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，每笔赎回申请不得低于 50 份基金份额。若基金份额持有人某笔交易类业务(如赎回、基金转换、转托管等)导致在销售机构单个交易账户保留的基金份额余额少于 50 份时，则基金管理人有权将投资人在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。

6、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见相关公告。

7、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

8、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费。两类基金份额的申购费率如下：

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

基金管理人可根据情况变更或增减特定投资群体申购本基金的销售机构，并按规定予以公告。

通过直销机构申购本基金的特定投资群体的申购费率如下表所示：

A 类基金份额		C 类基金份额
认购金额 (M)	申购费率	0%
M < 100 万	0.10%	
100 万 ≤ M < 200 万	0.06%	
200 万 ≤ M < 500 万	0.02%	
M ≥ 500 万	500 元/笔	

其他投资者申购本基金的申购费率如下表所示：



A 类基金份额		C 类基金份额
认购金额 (M)	申购费率	0%
M<100 万	1.00%	
100 万≤M<200 万	0.60%	
200 万≤M<500 万	0.20%	
M≥500 万	1000 元/笔	

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、登记和销售等各项费用。

在申购费按金额分档的情况下，如果投资人多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

## 2、赎回费率

本基金 A 类份额和 C 类份额采用相同的赎回费率，赎回费用按基金份额的时间分段设定如下：

基金的赎回费率表

持有期限 (T)	赎回费率
T<7 日	1.50%
7 日≤T<30 日	0.10%
T≥30 日	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。基金份额赎回费计入基金财产比例：对持续持有期少于 7 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对于持有期少于 30 日且不少于 7 日的投资人，将 25% 的赎回费计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定、基金合同约定以及对投资人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率、赎回费率。

5、当本基金各类份额发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规

规以及监管部门、自律规则的规定。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算方式

(1) A 类基金份额的申购份额的计算公式

1) 申购费用适用比例费率时, 计算公式为:

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

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

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

2) 申购费用适用固定金额, 计算公式为:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

上述计算结果均按照四舍五入方法, 保留小数点后 2 位, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例: 假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元, 某投资人(非特定客户群体)本次申购本基金 A 类基金份额 40 万元, 对应的本次申购费率为 1.00%, 该投资人可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 400,000 / (1 + 1.00\%) = 396,039.60 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 400,000 - 396,039.60 = 3,960.40 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 396,039.60 / 1.0560 = 375,037.50 \text{ 份}$$

即: 投资人(非特定客户群体)投资 40 万元申购本基金 A 类基金份额, 假定申购当日 A 类基金份额的净值为 1.0560 元, 可得到 375,037.50 份 A 类基金份额。

例: 假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0730 元, 某投资人(特定客户群体)本次申购本基金 A 类基金份额 50 万元, 对应的本次申购费率为 0.10%, 该投资人可得到的基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 500,000 / (1 + 0.10\%) = 499,500.50 \text{ 元}$$

申购费用=500,000-499,500.50 = 499.50 元

申购份额=499,500.50/1.0730 = 465,517.71 份

即：投资人（特定客户群体）投资 50 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额的净值为 1.0730 元，可得到 465,517.71 份 A 类基金份额。

## （2）C 类基金份额申购份额的计算公式

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例 4：假定 T 日 C 类基金份额净值为 1.0520 元，某投资人本次申购本基金 C 类基金份额 40 万元，该投资人可得到的基金份额为：

申购份额=400,000/1.0520 =380,228.14 份

即：投资人投资 40 万元申购本基金 C 类基金份额，假定申购当日 C 类基金份额的净值为 1.0520 元，可得到 380,228.14 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

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

例 5：某投资人赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 28 天，对应的赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2525 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2525=12,525 元

赎回费用=12,525×0.75%=93.94 元

净赎回金额=12,525-93.94=12,431.06 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 28 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2525 元，则其可得到的赎回金额为 12,431.06 元。

例 6：某投资人赎回 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 5 天，对应的赎

回费率为 1.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2613 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.2613 = 12,613 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,613 \times 1.50\% = 189.20 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,613 - 189.20 = 12,423.80 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 5 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2613 元，则其可得到的赎回金额为 12,423.80 元。

3、本基金分为 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类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。

## 八、申购与赎回的登记

投资人 T 日申购基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理相应的登记结算手续。

投资人 T 日赎回基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定，在指定媒介公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可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工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基

金资产净值。

4、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现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

5、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，或发生损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

10、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、10、11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，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全部或部分被拒绝的，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。

#### 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时报中国证监会备案，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。

## 十一、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基金份额净赎回申请(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)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，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的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。

在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一日基金总份额 25% 以上的赎回申请，基金管理人可以全部自动进行延期办理。具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类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。如该单个基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。

对于该单个基金份额持有人当日赎回申请中未超过上一开放日基金总份额 25%（含 25%）的赎回申请与其他持有人的赎回申请，基金管理人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该类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 个开放日以上(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。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并于两日内在指定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和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，基金管理人应在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 个工作日的各类基金份额净值。

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 个工作日的各类基金份额净值。

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 个工作日的各类基金份额净值。

## 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十四、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。

### 十五、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。

### 十六、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。

### 十七、基金份额的冻结和解冻

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。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结基金份额所产生的权益一并冻结,法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

### 十八、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### 十九、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下,基金管理人可在对基金份额

持有人利益无实质性不利影响的情形下，办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

二十、基金管理人可在不违反相关法律法规、不对基金份额持有人利益产生不利影响的前提下，根据届时具体情况对上述申购和赎回等安排进行补充和调整并提前公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对标的指数的有效跟踪。

### 二、投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款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相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

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：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%；在每个交易日日终，在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重构建基

金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当成份股发生配股、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，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

### （一）股票投资策略

#### 1、投资组合构建

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合。在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金按照标的指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

#### 2、投资组合调整

##### （1）定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。标的指数的样本股每年定期调整，指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。

##### （2）不定期调整

1) 根据指数编制规则，当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

2) 根据基金申购赎回情况，调整股票投资组合，以有效跟踪标的指数；

3) 当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。

##### （3）股票替代

通常情况下,本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的股票等特殊情况下,本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。

在选择替代股票时,为尽可能的降低跟踪误差,本基金将采用定性与定量相结合的方法,在对替代股票与被替代股票的基本面、股价技术面等指标进行相关性分析的基础上,优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好,流动性充裕的股票进行替代投资。

## (二) 存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上,根据审慎原则合理参与存托凭证的投资,以更好地跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## (三) 债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,参与债券投资,其投资目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,降低跟踪误差。

### 1、利率策略

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率趋势。根据相关因素的研究判断调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期。

### 2、债券类属配置策略

本基金将根据国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。

### 3、信用债券投资策略

本基金将根据国民经济运行周期阶段,分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,构造和优化组合。

## (四) 股指期货投资策略

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在进行股指期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场运行趋势的定量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配。本基金通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，提高投资组合的运作效率。

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。

#### （五）股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### （六）资产支持证券投资策略

本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。在具体投资过程中，重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总量规模，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。

#### （七）可转换债券投资策略

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

#### （八）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将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，谨慎进行投资。

#### （九）参与转融通证券出借业务投资策略

本基金投资参与转融通证券出借业务，将按照风险管理的原则，结合投资目标、比例限制、流动性情况、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与转融通出借业务的投资时机和投资比例。本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，积极主动的预测未来的利率趋势，选择风险调整后的收益高的品种进行参与，实现转融通证券出借业务对基金资产的最优贡献。在投资过程中，本基金将严格控制转融通证券出借业务的流动性风险和采用约定申报方式的信用风险管理，根据借券公司的分类评级、财务状况、管理水平和债务水平等因素，选择对手方，结合适度分散出借个股、出借期限和出借对手的理念方法，构造和优化组合，分散风险。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的 90%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（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) 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，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(14) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 在任何交易日日终，本基金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%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指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 95%，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；

3) 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%；

4) 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



过上一个交易日基金资产净值的 20%;

5) 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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(15) 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%; 本基金持有的单只流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%;

(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18) 本基金参与股票期权交易, 应遵守下列投资比例限制:

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;

2) 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(19) 本基金参与转融通证券出借业务, 应遵守下列投资比例限制:

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%;

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%;

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元;

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天, 平均剩余期限按照市值加权平均计算。

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不符合上述规定的，基金管理人不得新增转融通证券借出业务。

(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

(21) 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。

除第(2)、(10)、(16)、(17)、(19)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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，但中国证监会另有规定或上述各项另有约定的除外。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

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。在上述期间内，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以变更后的规定为准。如本基金增加投资品种，投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

## 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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，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

额持有人利益优先的原则，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，并履行信息披露义务。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、行政法规或监管机构取消上述禁止行为的，则本基金投资不再受相关限制。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $MSCI$  中国 A 股国际价值指数收益率\*95% + 银行活期存款利率（税后）\*5%。

基于本基金资产配置比例，选用该业绩比较基准能够反映本基金的风险收益特征。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，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，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 七、基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额

额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

5、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人根据本基金合同规定，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。

以下内容摘自中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,465,924.74	92.78
	其中：股票	15,465,924.74	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	946,670.00	5.68
	其中：债券	946,670.00	5.68
	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	217,314.65	1.30
8	其他资产	40,194.64	0.24
9	合计	16,670,104.03	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	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
---	------	---------	-----------

码			(%)
A	农、林、牧、渔业	1,394,907.80	8.57
B	采矿业	236,153.20	1.45
C	制造业	7,157,092.74	43.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	329,809.20	2.03
E	建筑业	1,063,058.00	6.53
F	批发和零售业	703,755.00	4.32
G	交通运输、仓储和邮政业	278,483.00	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	373,964.00	2.30
J	金融业	3,334,472.80	20.49
K	房地产业	540,954.00	3.32
L	租赁和商务服务业	11,304.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,475.00	0.07
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	30,496.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	15,465,924.74	95.04

(2) 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

4、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

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	000725	京东方A	114,100	684,600.00	4.21

2	002714	牧原股份	8,610	663,831.00	4.08
3	300498	温氏股份	28,360	517,002.80	3.18
4	601166	兴业银行	23,500	490,445.00	3.01
5	600000	浦发银行	40,600	393,008.00	2.42
6	601668	中国建筑	73,500	365,295.00	2.24
7	601012	隆基股份	3,600	331,920.00	2.04
8	600438	通威股份	8,300	319,052.00	1.96
9	000876	新希望	14,200	318,080.00	1.95
10	601288	农业银行	92,900	291,706.00	1.79

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

6、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	899,670.00	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	47,000.00	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	946,670.00	5.82

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	7,000	699,930.00	4.30
2	019640	20 国债 10	2,000	199,740.00	1.23
3	113044	大秦转债	470	47,000.00	0.29

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。

#### 9、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投资。

#### 10、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投资。

#### 11、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持有股指期货。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 12、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

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### (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持有国债期货。

##### (3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 13、投资组合报告附注

(1) 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除上海浦东发展银行股份有限公司（浦发银行）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020年8月11日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2020〕12号），对上海浦东发展银行股份有限公司未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目、延迟支付同业投资资金吸收存款等违法违规事实进行处罚。

本基金采用完全复制 MSCI 价值 Smart Beta 指数的策略，浦发银行是

MSCI 价值 Smart Beta 指数的前十大成分股, 我们判断所列处罚对其投资价值不会产生重大影响, 故依然按照完全复制指数的投资策略持有该股。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 14、其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	2,595.16
2	应收证券清算款	348.22
3	应收股利	-
4	应收利息	17,437.29
5	应收申购款	19,813.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,194.64

#### 15、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 16、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

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

#### 17、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## 第十部分 基金的业绩

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

本基金基金合同生效日为 2019 年 1 月 25 日，基金业绩数据截至 2020 年 12 月 31 日。

### 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

#### 中金 MSCI 价值 A

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
基金合同生效日起至 2019 年 12 月 31 日	19.27%	1.11%	19.90%	1.11%	-0.63%	0.00%
2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日	2.44%	1.26%	11.95%	1.29%	-9.51%	-0.03%
基金合同生效日起至 2020 年 12 月 31 日	22.18%	1.18%	34.23%	1.21%	-12.05%	-0.03%

#### 中金 MSCI 价值 C

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
基金合同生效日起至 2019 年 12 月 31 日	19.06%	1.11%	19.90%	1.11%	-0.84%	0.00%
2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日	2.18%	1.26%	11.95%	1.29%	-9.77%	-0.03%
基金合同生效日起至 2020 年 12 月 31 日	21.65%	1.18%	34.23%	1.21%	-12.58%	-0.03%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项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、基金财产的保管和处分

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。

## 第十二部分 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、股指期货合约、股票期权和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的非固定收益类有价证券的估值

(1) 交易所上市的非固定收益类有价证券（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) 交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。

#### 2、固定收益品种的估值

(1) 本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时，主要依据由第三方估值机构提供的价格数据；

(2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现

行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全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，按最近交易日债券第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全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) 交易所上市交易的可转换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；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

3、处于未上市期间的非固定收益类有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；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、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) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规

定确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、本基金投资股票期权合约，一般以股票期权当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、本基金参与转融通证券出借业务的，将参照行业协会的相关规定进行估值。

8、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

10、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

12、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，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按基金合同约定公告。

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，将各类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，由基金管理人按约定对外公布。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。

#### 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。当某类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。

### 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 0.50% 时，基金管理人应当公告。

(3) 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，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，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过错程度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。

(4) 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。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管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。

## 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、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价



格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值的;

4、法律法规、中国证监会规定或基金合同认定的其它情形。

### **七、基金净值的确认**

基金资产净值和各类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各类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,由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值信息按约定予以公布。

### **八、特殊情况的处理方法**

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第 11 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产净值估值错误处理。

2、由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构或登记结算公司等机构发送的数据错误,或由于不可抗力等原因,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或减轻由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可法律法规允许的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### **四、收益分配方案**

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

#### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为该类基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 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、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《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；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用及账户维护费用；
- 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 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

C 类基金份额销售服务费主要用于本基金 C 类基金份额的持续销售以及 C 类基金份额持有人服务等各项费用。

## 4、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付标的指数许可使用费。在通常情况下，指数使用许可费按每日基金资产净值每季度 0.0075% 的费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.0075\% \div \text{当季度天数}$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 5,000 美元或等值人民币（即不足 5000 美元时按照 5000 美元或等值人民币收取）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第 5-11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

5、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

### 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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 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披露；
- 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、基金的年度审计

- 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、期货相关业务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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。



## 第十六部分 基金的信息披露

一、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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，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销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。。

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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

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。

## （二）基金份额发售公告

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

## （三）《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（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

基金合同生效公告中应说明基金募集情况及基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员持有的基金份额、承诺持有期限等情况。

## （四）基金净值信息

《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指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额净值和基金份额累计净值。

## （五）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基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;
- 8、基金募集期延长或提前结束募集;
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十,基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
- 13、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,或者从事其它重大关联交易事项,中国证监会另有规定的情形除外;
- 14、基金收益分配事项;
- 15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;
- 17、本基金开始办理申购、赎回;
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理;
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延期支付赎回款项;
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;
- 22、调整基金份额类别的设置;
- 23、本基金变更标的指数;
- 24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时;
- 25、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

#### （九）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。

#### （十）投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货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等。

#### （十一）投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十二）投资流通受限证券的信息披露

基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后 2 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。

#### （十三）投资股票期权的信息披露

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权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。

#### （十四）参与转融通证券出借业务的信息披露

基金管理人应当在基金定期报告等文件中披露基金参与转融通证券出借业务的情况，并就报告期内发生的重大关联交易事项做详细说明。

(十五) 投资存托凭证的信息披露

本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

(十六) 中国证监会规定的其他信息。

## 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，指定专门部门及高级管理人员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等法律法规规定。

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、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力;
- 2、出现暂停估值的情形;
- 3、法律法规规定、中国证监会认定或《基金合同》约定的其他情形。

#### 八、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。



## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

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

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

##### （3）利率风险

利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

##### （4）债券收益率曲线风险

收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，不同信用水平的货币市场投资品种具有不同的收益率曲线结构，若收益率曲线没有如预期变化，可能导致基金投资决策出现偏差，从而影响基金的收益水平，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

##### （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。如果本基金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，使基金财产投资收益下降。虽然本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

基金的利润将主要通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降,从而使基金的实际收益下降。

#### (7) 再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率上升所带来的价格风险(即利率风险)互为消长。具体为当利率下降时,基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,将获得比以前较少的收益率,这将对基金的净值增长率产生影响。

#### (8) 债券回购风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险,其中,信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时,不能偿还全部或部分证券或价款,造成基金净值损失的风险;投资风险是指在进行回购操作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;而波动性加大的风险是指在进行回购操作时,在对基金组合收益进行放大的同时,也对基金组合的波动性(标准差)进行了放大,即基金组合的风险将会加大。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,对基金净值造成损失的可能性也就越大。

### 2、信用风险

信用风险主要指债券发行人因经营情况恶化等因素发生违约,或债券发行人拒绝履行还本付息义务,或由于债券发行人或债券本身信用等级降低导致债券价格波动等风险。信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### 3、流动性风险

由于市场或个券交易量不足,导致证券不能迅速、低成本的转变为现金,从而对基金收益造成不利影响。流动性风险还包括基金出现巨额赎回,导致没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

#### (1) 基金申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作,基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。基金管理人将加强对申购、赎回环节的管理,合理控制基金份额持有人集中度,审慎确认大额申购与大额赎回申请。具体内容详见本招募说明书“第八部分、基金份额的申购与赎回”章节。

#### (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所,主要投资对象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、债券和货币市场工具等),同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征,综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、暂停接受赎回申请、部分延期赎回或延缓支付赎回款项或中国证监会认定的其他措施。同时,如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的,基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

#### (4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,基金管理人将以保障投资者合法权益为前提,严格按照法律法规及基金合同的规定,谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用,基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则,及时有效地对风险进行监测和评估,使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时,投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响,基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作,全面保障投资者的合法权益。

### 4、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，如基金管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等会影响基金收益水平，从而产生风险。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

#### 5、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，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，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值，确保基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

#### 6、操作及技术风险

基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在本基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

根据证券交易资金前端风险控制的相关业务规则，上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司将对证券交易资金进行前端风险控制，因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中国结算可能采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。当资金前端控制出现异常情况或交易所、中国结算采取相应措施，或在管理人、托管人向交易所、中国结算申报资金前端控制有关信息时信息传递不及时、申报信息不准确、申报流程不规范等原因均可能造成基金财产的损失。

#### 7、合规性风险

基金管理或运作过程中，因违反国家法律、法规、监管部门的规定以及基金

合同有关规定而给基金财产带来损失的风险。

## 8、本基金特有风险

### (1) 跟踪指数投资风险

#### 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) 目标指数波动的风险

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

#### 3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

a. 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；

b. 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；

c. 由于成份券停牌、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；

d. 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；

e. 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；

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

#### 4) 目标指数变更的风险

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。

## （2）期货投资风险

1) 流动性风险：基金在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2) 基差风险：在使用期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为现货价格与期货合约价格波动不一致而遭受基差风险。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险：本基金所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 到期日风险：期货合约到期时，基金财产如持有为平仓合约，交易所将按照交割结算价将基金持有的合约进行现金交割，导致基金无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

5) 期货保证金不足风险：由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

6) 杠杆风险：期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

7) 对手方风险：基金管理人运用基金财产投资于期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

8) 平仓风险：期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，资产管理

计划财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### 9) 连带风险

为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### 10) 基金资产投资特定投资对象的其他风险

如期货经纪公司违反法律法规或交易所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。由于国家法律、法规、政策的变化、交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

#### (3) 资产支持证券投资风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资者发行，且仅在特定机构投资者范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

#### (4) 股票期权投资风险

本基金的投资范围包括股票期权，投资股票期权的主要风险包括但不限于市场风险、流动性风险、保证金风险、信用风险等。其中，市场风险指由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动，影响基金收益而产生风险；流动性风险指当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险；保证金风险指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险；信用风险指交易对手不愿或无法履行契约的风险。

#### (5) 流通受限证券投资风险

本基金可以投资流通受限证券，该类证券有一定期限的锁定期，锁定期内不得上市交易或转让，由此可能给基金带来更大的流动性风险、操作风险和估值风险等各类风险。

#### (6) 发起式基金的风险

本基金是发起式基金，在基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产

规模低于 2 亿元，基金合同应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

#### （7）科创板股票投资风险

科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

##### 1) 市场风险

科创板个股相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，个股市场风险加大。科创板竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的前五个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%）、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

##### 2) 流动性风险

科创板投资门槛较高，由此可能导致整体流动性相对较弱。此外科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

##### 3) 信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

##### 4) 集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

##### 5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将较为显著。



## 6) 监管规则及政策变化风险

科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，导致基金投资运作产生相应变化。此外，国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

### (8) 参与转融通证券出借业务风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：

1) 流动性风险：面临大额赎回时可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险。

2) 信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿以及借券费用的风险。

3) 市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

为了更好的防范融通证券出借业务所面临的各类风险，基金管理人将合理分散出借期限与借券证券公司的集中度。对通过约定申报方式参与的出借业务借券证券公司进行尽职调查与准入管理。加强关联交易管理，遵循持有人利益优先原则，按照市场公平合理价格执行。加强压力测试管理，合理确定出借证券的范围、期限和比例，并制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人利益。

### (9) 存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证。除面临与其他投资沪深市场股票的基金共同的风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监

管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

## 9、其他风险

(1) 随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险。

(2) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

(3) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

(4) 基金管理人、基金托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(5) 其他不可预知、不可防范的风险。

## 二、声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或基金合同约定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，并自决议生效后 2 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》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 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、具有证券、期货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财产；
- (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) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 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剩余财产中支付。

#### 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，按基金份额持有人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具有证券、期货相关业务资格的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 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。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件 1。

## 第二十部分 托管协议的内容摘要

托管协议的内容摘要见附件 2。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，可增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、对账单的寄送服务

1、每次交易结束后，投资人可在 T+2 日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或在 T+2 日后通过电话、网上服务手段查询交易确认情况。基金管理人向投资人寄送交易确认单。

2、每季度结束后 10 个工作日内，基金管理人向定制对账单的基金份额持有人寄送纸质季度对账单；每年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向定制对账单的基金份额持有人寄送纸质年度对账单。

### 二、定期投资计划

基金管理人通过销售机构为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资人可以定期申购基金份额，具体实施时间、方法另行公告。

### 三、网上理财服务

通过本基金管理人网站，投资人可获得如下服务：

#### 1、自助开户、交易

本基金管理人已开通个人的网上直销交易业务。个人投资者可通过基金管理人网站（[www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.com)）办理开立基金账户、基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改等各类业务。

#### 2、查询服务

个人投资人和机构投资人可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息。

#### 3、信息资讯服务



投资人可以通过基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息,包括基金的法律文件、基金定期报告、基金临时公告及基金管理人最新动态等相关资料。

#### 四、电子邮件服务

基金管理人为投资人提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值查询等服务。

#### 五、客户服务中心电话服务

投资人或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,拨打基金管理人全国统一客服电话 400-868-1166(免长途话费)可享有如下服务:

1、自助语音服务:客服中心自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务,投资人可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息。

2、人工电话服务:客服可以为投资人提供业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理等服务。

3、电话留言服务:非人工服务时间或线路繁忙时,投资人可进行电话留言。

基金管理人网站和电子信箱

基金管理人网址: [www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.com)

电子信箱: [services@ciccfund.com](mailto:services@ciccfund.com)

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,请联系基金管理人客服电话并转人工电话服务进行咨询。

## 第二十二部分 其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要(2020 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2020-2-29
2	中金基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020-3-21
3	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2020-3-28
4	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-3-30
5	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-3-31
6	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-4-21
7	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2019 年年度报告及其摘要	中国证监会规定媒介	2020-4-21
8	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-4-22
9	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2020-4-22
10	中金基金管理有限公司关于中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2020-4-29
11	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同及托管协议提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-4-29
12	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同、托管协	中国证监会规定媒介	2020-4-29

	议		
13	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书及其摘要(2020 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2020-5-1
14	中金基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2020-5-28
15	中金基金管理有限公司副总经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020-6-30
16	中金基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-7-21
17	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2020-7-21
18	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-8-29
19	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年中期报告及其摘要	中国证监会规定媒介	2020-8-29
20	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020-9-1
21	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
22	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
23	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020-11-7
24	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 4 号)	中国证监会规定媒介	2020-11-10
25	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020-11-10
26	中金基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-16
27	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同、托管协议	中国证监会规定媒介	2020-12-16
28	中金基金管理有限公司中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资	中国证监会规定媒介	2020-12-16

	基金基金合同		
29	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金更新招募说明书(2020 年第 5 号)	中国证监会规定媒介	2020-12-18
30	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2020-12-18
31	中金基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-18
32	中金基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会规定媒介	2020-12-24
33	中金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定媒介	2021-1-16
34	中金基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-1-22
35	中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-1-22

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资人可在办公时间查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（[www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.com)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十四部分 备查文件

(一) 中国证监会准予中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金注册的文件

(二) 《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金基金合同》

(三) 《中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金托管协议》

(四) 关于申请募集中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金之法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批复和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批复和营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。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。

中金基金管理有限公司

2021 年 2 月 3 日

## 附件 1: 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### (一) 基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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,自主作出投资决策,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) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《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议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 发起资金提供方持有发起资金认购的基金份额不少于 3 年；
- (11) 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》及有关法律的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和融通证券出借业务；

(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/期货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、定期定额投资、转托管和非交易过户等业务规则；

(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净值信息,确定基金份额申购、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) 编制季度报告、中期报告和年度报告;
- (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前提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活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) 基金托管人的权利和义务

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、证券账户等投资所需账户，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》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等投资所需账户, 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;
- (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;
- (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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 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) 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管理人、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》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》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议；

(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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规或中国证监会另有规定外，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》，除基金合同另有约定外；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 本基金与其他基金的合并;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (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) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- (12) 对基金合同当事人权利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) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式、调整基金份额类别设置;
- (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;
- (5) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资、非交易过户、转托管等业务规则;
- (6) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金推出新业务或服务;
- (7) 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集时，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、代表基金份额 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，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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，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、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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日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基金份额少于本基金在权益登记日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基金份额应不少于本基金在权益登记日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或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

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基金份额不小于在权益登记日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基金份额小于在权益登记日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以上（含三分之一）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。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,具体方式在会议通知中列明。

#### (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基金份额有一票表决权。

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。除基金合同另有约定外，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异议，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 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、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或基金合同约定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，并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》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （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、具有证券、期货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财产；

(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)对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(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剩余财产中支付。

(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，按基金份额持有人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具有证券、期货相关业务资格的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(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。

#### **四、争议的处理**

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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（不含港澳台立法）管辖并从其解释。

#### **五、基金合同的存放及查阅方式**

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

## 附件 2、托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人(也可称资产管理人)

名称: 中金基金管理有限公司

住所: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

邮政编码: 100004

法定代表人: 胡长生

成立时间: 2014 年 2 月 10 日

批准设立机关: 中国证监会

批准设立文号: 证监许可[2014]97 号

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 4 亿元人民币

存续期间: 持续经营

经营范围: 基金募集; 基金销售; 特定客户资产管理; 资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### (二) 基金托管人(也可称资产托管人)

名称: 招商银行股份有限公司(简称: 招商银行)

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码: 518040

法定代表人: 缪建民

成立时间: 1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号: 证监基金字[2002]83 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 人民币 252.20 亿元

存续期间: 持续经营



## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。《基金合同》明确约定基金投资证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人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。

### 1. 本基金的投资范围为:

本基金投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权、同业存单、银行存款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相关规定)。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

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。

### 2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为:

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金资产净值的 90%;在每个交易日日终,在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)的资产不低于基金资产净值的 90%;

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权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; 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(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) 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, 债券回购到期后不得展期;

(13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(14) 本基金参与股指期货交易, 需遵守下列投资比例限制:

1) 在任何交易日日终, 本基金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%;

2) 在任何交易日日终,持有的买入股指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 95%,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;

3) 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%;

4) 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个交易日基金资产净值的 20%;

5) 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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(15) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%;本基金持有的单只流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%;

(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18) 本基金参与股票期权交易,应遵守下列投资比例限制:

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;

2) 开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(19) 本基金参与转融通证券出借业务，应遵守下列投资比例限制：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；
- 2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；
- 3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；
- 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

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不符合上述规定的，基金管理人不得新增转融通证券借出业务。

(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

(21) 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。

除第 (2)、(10)、(16)、(17)、(19) 项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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，但中国证监会另有规定或上述各项另有约定的除外。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

如本基金增加投资品种，投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：

- (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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

4. 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，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，并履行信息披露义务。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、行政法规或监管机构取消上述禁止行为的，则本基金投资不再受相关限制。

5.基金管理人应当自基金合同生效日起 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。在上述期间内，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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资比例不符合上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

6.如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

(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。对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并通知基金管理人。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1.本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，基金管理人履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。

2.基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，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。

(1)基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

(2)基金管理人负责控制流动性风险，并承担因控制不力而造成的损失。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足基金正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

(3)基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因基金管理人员工职务行为导致基金财产受到损失的，需由基金管理人承担由此造成的损失。

(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。

(三)基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划付、账目核对、到期兑付、提前支取

#### 1.基金投资银行存款协议的签订

(1)基金管理人应与符合资格的存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》(以下简称《总体合作协议》)，确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。

(2)基金托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款协议书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

(3) 基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法等。

(4) 由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称“存款分支机构”）寄送或上门交付存款证实书或其他有效存款凭证的，基金托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

(5) 基金管理人应在《存款协议书》中规定，基金存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管账户，并在《存款协议书》写明账户名称和账号，未划入指定账户的，由存款银行承担一切责任。

(6) 基金管理人应在《存款协议书》中规定，在存期内，如本基金银行账户、预留印鉴发生变更，管理人应及时书面通知存款行，书面通知应加盖基金托管人预留印鉴。存款分支机构应及时就变更事项向基金管理人、基金托管人出具正式书面确认书。变更通知的送达方式同开户手续。在存期内，存款分支机构和基金托管人的指定联系人变更，应及时加盖公章书面通知对方。

(7) 基金管理人应在《存款协议书》中规定，因定期存款产生的存单不得被质押或以任何方式被抵押，不得用于转让和背书。

## 2. 基金投资银行存款时的账户开设与管理

(1) 基金投资于银行存款时，基金管理人应当依据基金管理人与存款银行签订的《总体合作协议》、《存款协议书》等，以基金的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行账户。

(2) 基金投资于银行存款时的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

## 3. 存款凭证传递、账目核对及到期兑付

### (1) 存款证实书等存款凭证传递

存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。基金管理人应在《存款协议书》中规定，存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证（下称“存款凭证”），该存款凭证为基金存款确认或到期提款的有效凭证，且对应每笔存款仅能开具唯一存款凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款凭证复印件并与基金托管人电话确认

收妥后，将存款凭证原件通过快递寄送或上门交付至基金托管人指定联系人；若存款银行分支机构代为保管存款凭证的，由存款银行分支机构指定会计主管传真一份存款凭证复印件并与基金托管人电话确认收妥。

### （2）存款凭证的遗失补办

存款凭证在邮寄过程中遗失的，由基金管理人向存款银行提出补办申请，基金管理人应督促存款银行尽快补办存款凭证，并按以上（1）的方式快递或上门交付至托管人，原存款凭证自动作废。

### （3）账目核对

每个工作日，基金管理人应与基金托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

基金管理人应在《存款协议书》中规定，对于存期超过 3 个月的定期存款，存款银行应于每季末后 5 个工作日内向基金托管人指定人员寄送对账单。因存款银行未寄送对账单造成的资金被挪用、盗取的责任由存款银行承担。

存款银行应配合基金托管人对存款凭证的询证，并在询证函上加盖存款银行公章寄送至基金托管人指定联系人。

### （4）到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过快递将存款凭证原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款银行未收到存款凭证原件的，应与基金托管人电话询问。存款到期前基金管理人与存款银行确认存款凭证收到并于到期日兑付存款本息事宜。

基金托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不符时，通知基金管理人与存款银行接洽存款到账时间及利息补付事宜。基金管理人应将接洽结果告知基金托管人，基金托管人收妥存款本息的当日通知基金管理人。

基金管理人应在《存款协议书》中规定，存款凭证在邮寄过程中遗失的，存款银行应立即通知基金托管人，基金托管人在原存款凭证复印件上加盖公章并出具相关证明文件后，与存款银行指定会计主管电话确认后，存款银行应在到期日将存款本息划至指定的基金资金账户。如果存款到期日为法定节假日，存款银行顺延至到期后第一个工作日支付，存款银行需按原协议约定利率和实际延期天数



支付延期利息。

#### 4.提前支取

如果在存款期限内,由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因,基金管理人可以提前支取全部或部分资金。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款银行签订的《存款协议书》执行。

#### 5.基金投资银行存款的监督

基金托管人发现基金管理人在进行存款投资时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算,若因基金管理人拒不执行造成基金财产损失的,相关损失由基金管理人承担,基金托管人不承担任何责任。

(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。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人,否则由此造成的损失应由基金管理人承担。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进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单,但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定时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,但不得再发生新的交易。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券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 个交易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。若未履约的交易

对手在基金管理人确定的时间内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) 本基金投资流通受限证券，应遵守《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》等有关监管规定。

1. 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。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行股票，且限于由中国证券登记结算有限责任公司、中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行股票。

本基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

2. 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。

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。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人

应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

3.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、应划付的认购款、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。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

4.基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

5. 基金管理人应在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。

(六)基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务，并应符合法律法规及监管机构的相关规定。

(七)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、各类基金份额净值计算、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。

(八)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、邮件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。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应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。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。

(九)基金管理人应积极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。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，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。

(十)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及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担，托管人在履行其通知义务后，予以免责。

(十一)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。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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、托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到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管理人发出回函，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。

(三)基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供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。

(四)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### 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投资所需的相关账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5.基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的资产及实物证券等在基金托管人保管期间的损坏、灭失，基金托管人不承担由此产生的责任。
- 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资金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。
- 7.基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金资产（包括但

不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等)及其收益,由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。

8.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) 基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应开立“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》、《运作办法》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为基金开立的基金资金账户,同时在规定时间内,基金管理人应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。

## (三) 基金资金账户的开立和管理

1.基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户(也可称为“托管账户”),保管基金的银行存款,并根据基金管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“中金 MSCI 中国 A 股国际价值指数发起式证券投资基金”,预留印鉴为基金托管人印章。

2.基金资金账户的开立和使用,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任何其他银行账户;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.基金资金账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

## (四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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、结算保证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，按有关规定开立、使用并管理；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）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）其他账户的开立和管理

1.基金管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等，基金托管人按照规定开立期货结算账户等投资所需账户。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和市场监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和市场监控中心登录密码重置由基金管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

基金托管人和基金管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。基金管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给基金托管人。

2.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，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新

账户按有关规定使用并管理。

3.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等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （八）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。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后不少于 15 年。

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公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。基金管理人向基金托管人提供的合同传真件与基金管理人留存原件不一致的，以传真件为准。

## 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

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类基金份额净值是指估值日该类份额基金资产净值除以估值日该类基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。



基金管理人每个工作日计算基金资产净值、各类基金份额净值，经基金托管人复核，按约定公告。

## 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、各类基金份额净值发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

3. 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，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净值信息的计算结果对外予以公布。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。

### （二）基金资产的估值

基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定进行估值。

### （三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理份额净值错误。

### （四）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （五）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、记录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。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。

### （六）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

基金管理人、基金托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核;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及复核;在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制及复核;在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制及复核。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。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。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、中期报告或者年度报告。

(七)在有需要时,基金管理人应每季度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、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金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,则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前,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,并保证其的真实性、准确性和完整性。基金管理人和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、争议的解决方式

双方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,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。仲裁裁决是终局的，对双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，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。

本协议受中华人民共和国法律（不含港澳台立法）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应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止的情形

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 3、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 4、发生法律法规或《基金合同》规定的其他终止事项。

### （三）基金财产的清算

基金管理人与基金托管人按照《基金合同》的约定处理基金财产的清算。