

**建信深证基本面 60 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
招募说明书（更新）**

**基金管理人：建信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国民生银行股份有限公司**

**二〇二一年三月**

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 7 月 14 日证监许可[2011]1092 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 9 月 8 日正式生效。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，本基金投资策略所特有的风险（包括指数编制机构停止服务的风险，成份股停牌风险，跟踪误差控制未达约定目标的风险等）等。本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人可按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后对相关成份券进行调整。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本基金本次根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指

引》对基金合同及招募说明书中有关内容进行更新。本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 10 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

第一部分 前言 .....	5
第二部分 释义 .....	6
第三部分 基金管理人 .....	11
第四部分 基金托管人 .....	20
第五部分 相关服务机构 .....	27
第六部分 基金的募集 .....	43
第七部分 基金合同的生效 .....	48
第八部分 基金份额的申购与赎回 .....	49
第九部分 基金的投资 .....	61
第十部分 基金的业绩 .....	75
第十一部分 基金的财产 .....	77
第十二部分 基金资产的估值 .....	79
第十三部分 基金的收益分配 .....	85
第十四部分 基金的费用与税收 .....	87
第十五部分 基金的会计与审计 .....	90
第十六部分 基金的信息披露 .....	91
第十七部分 风险揭示 .....	96
第十八部分 基金的终止与清算 .....	102
第十九部分 基金合同的内容摘要 .....	104
第二十部分 托管协议的内容摘要 .....	127
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	147
第二十二部分 其他应披露事项 .....	150
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	152
第二十四部分 备查文件 .....	153

## 第一部分 前言

《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规的规定以及《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《基金合同》）编写。

本招募说明书阐述了建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 第二部分 释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、《基金合同》：《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及其任何有效的修订和补充；

2、中国：中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）；

3、法律法规：中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件；

4、《基金法》：《中华人民共和国证券投资基金法》；

5、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

6、《运作办法》：《公开募集证券投资基金运作管理办法》；

7、《信息披露办法》：《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》；

8、元：中国法定货币人民币元；

9、基金或本基：依据《基金合同》所募集的建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金；

10、招募说明书：《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新；

11、托管协议：基金管理人与基金托管人签订的《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效修订和补充；

12、发售公告：《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告》；

13、《流动性风险管理规定》：《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及不时作出的修订；

14、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

- 15、《业务规则》：《建信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》；
- 16、中国证监会：中国证券监督管理委员会；
- 17、银行监管机构：中国银行保险监督管理委员会或其他经国务院授权的机构；
- 18、基金管理人：建信基金管理有限责任公司；
- 19、基金托管人：中国民生银行股份有限公司；
- 20、基金份额持有人：根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
- 21、基金代销机构：符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构；
- 22、销售机构：基金管理人及基金代销机构；
- 23、基金销售网点：基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点；
- 24、注册登记业务：基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 25、基金注册登记机构：办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为建信基金管理有限责任公司；
- 26、《基金合同》当事人：受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
- 27、个人投资者：符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人；
- 28、机构投资者：符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织；
- 29、合格境外机构投资者：符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；

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

31、标的指数：指深证基本面 60 指数及其未来可能发生的变更；

32、目标ETF：指另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（简称ETF），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。发售时，本基金选择深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证基本面 60ETF”）为目标ETF；

33、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标ETF的ETF联接基金；

34、基金合同生效日：基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日；

35、募集期：自基金份额发售之日起不超过3个月的期限；

36、基金存续期：《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间；

37、日/天：公历日；

38、月 公历月；

39、工作日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

40、开放日：销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日；

41、T日：申购、赎回或办理其他基金业务的申请日；

42、T+n日：自T日起第n个工作日（不包含T日）；

43、认购：在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为；

44、发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为；

45、申购：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过3个月的时间开始办理；

46、赎回：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的



时间开始办理；

47、巨额赎回：在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形；

48、基金账户：基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户；

49、交易账户：各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

50、基金转换：投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为；

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

52、基金收益：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入；

53、基金资产总值：基金拥有的包括目标 ETF 份额在内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；

54、基金资产净值：基金资产总值扣除负债后的净资产值；

55、基金份额净值：基金资产净值除以基金份额总数；

56、基金资产估值：计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程；

57、指定媒介：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；

58、流动性受限资产：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；

59、不可抗力：本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在基金合同签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件；

60、基金份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值；

61、A类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别；

62、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申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别；

63、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用。

64、基金产品资料概要：指《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

成立日期：2005 年 9 月 19 日

法定代表人：孙志晨

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准设立。公司的股权结构如下：中国建设银行股份有限公司，65%；美国信安金融服务公司，25%；中国华电集团资本控股有限公司，10%。

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

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

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

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

孙志晨先生，董事长，1985 年获东北财经大学经济学学士学位，2006 年获得长江商学院 EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建

设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。2005 年 9 月出任建信基金管理公司总裁，2018 年 4 月起任建信基金管理公司董事长。

张军红先生，董事，现任建信基金管理公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士学位。历任中国建设银行总行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员，总行零售业务部主任科员，总行个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理，总行行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理，总行投资托管服务部总经理助理、副总经理，总行投资托管业务部副总经理，总行资产托管业务部副总经理。2017 年 3 月出任建信基金管理公司监事会主席，2018 年 4 月起任建信基金管理公司总裁。

李建峰先生，董事，现任中国建设银行总行个人金融部（消费者权益保护部）副总经理。1997 年毕业于陕西财经学院（现西安交通大学），获信息经济专业硕士学位。历任中国建设银行总行个人存款与投资部电话银行中心银行卡处处长，中国建设银行总行个人存款与投资部电话银行中心副总经理，中国建设银行总行个人存款与投资部副总经理，中国建设银行总行个人金融部（消费者权益保护部）副总经理。

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

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

王志平先生，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司党委委员、副总经理。毕业于湘潭矿业学院，获工学学士学位。历任北京市水利局机械处干

部，人事部办公厅办公室干部、科员，国务院稽查特派员总署稽查特派员助理兼秘书，国有重点大型企业监事会科员级专职监事、副科员级专职监事、主任科员，国务院国资委企业分配局主任科员、配套改革处副处长、分配调控处副处长、调研员，中国华电集团资本控股有限公司总经理助理，中国华电集团资本控股有限公司党委委员、副总经理。

张然女士，独立董事，现任中国人民大学商学院会计系教授、博士生导师。2006 年获美国科罗拉多大学立兹商学院工商管理博士学位，国家青年长江学者、全国会计领军人才、中国会计学术研究会副秘书长，2006 年至 2019 年执教于北京大学光华管理学院，现任中国人民大学商学院会计系教授、博士生导师。

史亚萍女士，独立董事，现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994 年毕业于对外经济贸易大学，获国际金融硕士；1996 年毕业于耶鲁大学研究生院，获经济学硕士。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理有限公司、中金资本、嘉浩控股有限公司等多家金融机构担任管理职务。

邱靖之先生，独立董事，现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业，获 EMBA 学位，全国会计领军人才，中国注册会计师，注册资产评估师，高级会计师，澳洲注册会计师。1999 年 10 月加入天职国际会计师事务所，现任首席合伙人。

## 2、监事会成员

马美芹女士，监事会主席，高级经济师，1984 年毕业于中央财政金融学院，获学士学位，2009 年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984 年加入中国建设银行，历任中国建设银行总行筹资储蓄部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理（技术二级），总行个人金融部副总经理，总行个人存款与投资部副总经理。2018 年 5 月起任建信基金管理公司监事会主席。

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

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与战略研究部经理。1992 年获北京工业大学工业会计专业学士，2009 年获中央财经大学会计专业硕士。曾供职于北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所。2004 年加入中国华电集团，历任中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股计划财务部经理、财务部经理，企业融资部经理、机构与风险管理部经理、机构与战略研究部经理。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理公司信息技术总监。1995 年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。1995 年 8 月加入中国建设银行，历任中国建设银行北京分行信息技术部干部，信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长；2005 年 8 月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理，信息技术总监兼金融科技部总经理，信息技术总监。

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

刘颖女士，职工监事，ACCA 资深会员，现任建信基金管理公司审计部总经理。1997 年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010 年获香港中文大学工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师，华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006 年 12 月加入建信基金管理公司，历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资深稽核员、内控合规部副总经理、内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）总经理、审计部总经理。

### 3、公司高级管理人员

张军红先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行；2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部；2005年9月加入建信基金管理公司，2015年8月6日起任副总裁，2019年7月18日起兼任首席信息官。

吴曙明先生，副总裁，硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总

公司工作；1999年7月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入建信基金管理公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。

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

马勇先生，副总裁，硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究设计院工作。1998年7月加入中国建设银行总行，历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书，高端客户部总经理助理，财富管理与私人银行部总经理助理、副总经理，建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司，2018年11月13日起任副总裁；2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

#### 4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

#### 5、基金经理

薛玲女士，金融工程及指数投资部总经理助理，博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作，任项目经理；2010年1月至2013年4月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作，任高级软件工程师；2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作，历任研究员、投资经理；2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部，历任基金经理助理、基金经理，2018年5月起兼任部门总经理助理。2016年7月4日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2017年5月27日至2018年4月25日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017年9月28日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2017年12月20日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经

理；2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年3月5日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018年10月25日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

梁洪昀先生：2011年9月8日至2016年7月20日。

路龙凯先生：2016年4月11日至2017年9月28日。

薛玲女士：2017年9月28日至今。

#### 6、投资决策委员会成员

张军红先生，总裁。

赵乐峰先生，总裁特别助理。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

梁珉先生，资产配置与量化投资部总经理。

叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理。

张戈先生，资产配置及量化投资部总经理助理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、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、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；



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

12、中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 3、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不得以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

(2) 独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

(3) 相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(4) 有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过

对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

（5）防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。

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

## 2、内部控制的主要内容

### （1）控制环境

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

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

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

### （2）风险评估

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

### （3）操作控制

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

门之间相互核对、相互牵制。

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

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

#### （4）信息与沟通

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

#### （5）监督与内部稽核

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

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：1996 年 02 月 07 日至长期

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十多年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009 年 11 月 26 日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

民生银行荣获第十三届上市公司董事会“金圆桌”优秀董事会奖；

民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017 年度小微金融服务银行”；

民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016 中国地区最佳财富管理私人银行”奖项；

民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项；

民生银行荣获 VISA 颁发的“最佳产品设计创新奖”；

民生银行在经济观察报举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”；

民生银行荣获全国银行间同业拆借中心授予的“2016 年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016 年度银行间本币市场优秀衍生品交易商”及“2016 年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项；

民生银行荣获中国银行间交易协商会授予的“2016 年度优秀综合做市机构”和“2016 年度优秀信用债做市商”奖项；

民生银行荣获英国 WPP（全球最大的传媒集团之一）颁发的“2017 年度最具价值中国品牌 100 强”；

民生银行在中国资产证券化论坛年会上被授予“2016 年度特殊贡献奖”。

## 2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有 26 年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备

组组长、行长、党委书记。

### 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 74 人，平均年龄 38 岁，100% 员工拥有大学本科以上学历，64% 以上员工具有硕士以上文凭。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2020 年 9 月 30 日，中国民生银行已托管 257 只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌，近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心，致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源，对外广泛搭建客户服务平台，向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务，得到各界的充分认可，也在市场上树立了良好品牌形象，成为市场上一家有特色的托管银行。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖，尤其 2019 年，获得由金融时报社和国家金融与发展实验室共同评出的“年度最佳托管银行”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念，严格控制合规风险，保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业

监管规则。

(3) 以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障，以完善健全的制度为基础，以落实到位的过程控制为着眼点，以先进的信息技术手段为依托，建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、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。

## 2. 内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会，对高级管理层负责，支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

总行各部门紧密配合，共同把控资产托管业务运行中的风险，具体职责与分工如下：总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构，是全行风险管理的统筹部门，对资产托管部的风险控制工作进行指导；总行法律事务部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等文本的审定；总行内控合规部负责该业务与管理的合规性审查、检查与督导整改；总行审计部对全行托管业务进行内部审计。包括定期内部审计、现场和非现场检查等；总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。按资产托管部需求对由托管业务引发的声誉风险事件进行定向舆情监测，对由托管业务引起的声誉风险进行应急处置，包括与全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。

## 3. 内部风险控制原则

(1) 合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2) 全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员，并涵盖资产托管业务各环节。

(3) 有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行，任何人都没有超越制度约束的权力。

(4) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，控制资产托管业务中风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5) 及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、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进行及时的修改或完善。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(6) 独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险监督中心是资产托管部下设的执行机构，不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开，以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7) 相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确，相互牵制，通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8) 防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

#### 4. 内部风险控制制度和措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 5. 资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。



(2) 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置风险与合规管理中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行审计。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人

改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

##### （1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：孙志晨

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

##### （2）网上交易

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

#### 2、代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号法定代表人：田国立

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### （2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

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

##### （3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

网址：<http://www.95559.com.cn>

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务电话：95555（或拨打各城市营业网点咨询电话）

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

(6) 中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(7) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦

法定代表人：高迎欣

传真：010-58560720

客户服务电话：95568

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

(8) 渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

客服电话：95541

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

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

客户服务电话：95526

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

(10) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(11) 阳光人寿保险股份有限公司

企业地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦

法定代表人：李科

客户服务电话：95510

公司网址：<http://www.sinosig.com>

(12) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：葛新

客户服务热线：95055-4

网址：<https://www.baiyingfund.com/>

(13) 北京蛋卷基金销售有限公司

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

法定代表人：钟斐斐

客户服务热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com/>

(14) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客户服务热线：010-56282140

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

(15) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 5 层 505 室

法定代表人：曲阳

客户服务热线：400-803-1188

网址：<http://www.bzfunds.com>

(16) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法定代表人：樊怀东

客户服务电话：4000-899-100

网址：<http://www.yibaijin.com>

(17) 大泰金石基金销售有限公司

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

法定代表人：姚杨

客户服务热线：400-928-2266

网址：<https://www.dtfunds.com/>

(18) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：郑立坤

客户服务热线：95357

网址：<http://www.18.cn>

(19) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室

法定代表人：于海锋

客户服务电话： 400-080-3388

网址：<https://www.puyifund.com/>

(20) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、

04 单位

法定代表人：刘鹏宇

客户服务电话：0755-83999913

网址：<http://www.fujiwealth.cn/>

(21) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

客户服务热线：400-111-0889

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

(22) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

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

(23) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 楼 5 楼 503

法定代表人：温丽燕

客户服务电话：4000-555-671

网址：<http://www.hgccpb.com>

(24) 和谐保险销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302

法定代表人：蒋洪

客户服务热线：95569

网址：<https://www.hx-sales.com>

（25）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

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

（26）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：周斌

客户服务电话：4007868868

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

（27）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客户服务电话：400-618-0707

网址：<http://www.hongdianfund.com/>

（28）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

法定代表人：路昊

客户服务电话：952303

网址：<http://www.huaruisales.com>

（29）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客户服务电话：400-820-2819

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

（30）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层

5312-15 单元



法定代表人：赵学军

客户服务热线：400-021-8850

网址：<https://www.harvestwm.cn>

(31) 上海联泰基金销售有限公司

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

法定代表人：燕斌

客户服务热线：4000-466-788

(32) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：王之光

客户服务电话：400-821-9031

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

(33) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

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

(34) 民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

法定代表人：贲惠琴

客户服务电话：021-50206003

网址：<http://www.msftec.com>

(35) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：刘汉青

客户服务热线：95177

网址：<http://www.snjjjin.com>

(36) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

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

(37) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心 A36 楼

法定代表人：顾敏

客户服务热线：400-999-8800

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

(38) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

客户服务热线：400-817-5666

网址：<https://www.amcfortune.com>

(39) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客户服务热线：400-921-7755

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

(40) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客户服务热线：021-50810673

网址：<http://www.wacaijijin.com>

(41) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务热线：400-821-0203

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

(42) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：马勇

客户服务热线：400-166-1188

网址：<http://www.jrj.com.cn/>

(43) 北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：4008188866

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

(44) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

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

法定代表人：张冠宇

客户服务热线：400-819-9868

网址：<http://www.tdyhfund.com/>

(45) 腾安基金销售（深圳）有限公司

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

法定代表人：刘明军

客户服务热线：95017(拨通后转 1 再转 6)

网址：<http://www.tenganxinxi.com/>

(46) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188

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

(47) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

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

(48) 北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：季长军

客户服务电话：400-819-6665

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

(49) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：赵芯蕊

客户服务热线：010-62675369

网址：<https://trade.xincai.com/web/promote>

(50) 奕丰基金销售有限公司

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

法定代表人：TEO WEE HOWE

客户服务热线：400-684-0500

网址：<https://www.ifastps.com.cn>

(51) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

(52) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

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

(53) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：王松（代）

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(54) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(55) 招商证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(56) 长城证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：曹宏

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(57) 海通证券股份有限公司

地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：400-8888-001，（021）962503

网址：www.htsec.com

(58) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(59) 中信建投证券有限责任公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

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

(60) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

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

(61) 东北证券股份有限公司

地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(62) 渤海证券股份有限公司

地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

客户服务电话：4006515988

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

(63) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：祝瑞敏

客户服务电话：400-800-8899

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

(64) 平安证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区金田路 4306 号荣超大厦 18 楼

法定代表人：何之江

客户服务电话：4008866338

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

(65) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 20 层

法定代表人：王连志

客户服务电话：0755—82825555

网址：www.axzq.com.cn

(66) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(67) 中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

网址：www.citics.com

(68) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：周易

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

(69) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国家大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李琦

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(70) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：李俊杰

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

(71) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：刘宛晨

客户服务电话：0731-4403340

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

(72) 东海证券股份有限公司

地址：常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：赵俊

客服热线：95531

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

(73) 浙商证券股份有限公司

地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服热线：95345

网址：<https://www.stocke.com.cn/zszq/index/index.jsp>

(74) 广州证券股份有限公司

地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客服热线：95396

网址：<http://www.gzs.com.cn>

(75) 中信期货有限公司

地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

客服热线：400-990-8826

网址：<https://www.citicsf.com/e-futures/>

(76) 华融证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

客服热线：95390

网址：<http://www.hrsec.com.cn/>

(77) 中信证券华南股份有限公司



地址：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

法定代表人：胡伏云

客服电话：95548

网址：<http://www.gzs.com.cn/>

（78）华西证券股份有限公司

法定代表人：杨炯洋

地址：成都市高新区天府二街 198 号

客户服务电话：95584

网址：<http://www.hx168.com.cn/hxzq/hxindex.html>

## 二、注册登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：孙志晨

联系人：郑文广

电话：010-66228888

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

联系人：王珊珊

经办注册会计师：王珊珊、贺耀

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

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

本基金募集申请已经中国证监会 2011 年 7 月 14 日证监许可[2011]1092 号文核准。

### 二、基金类型

ETF 联接基金。

### 三、基金的运作方式

契约型、开放式。

### 四、基金存续期间

不定期。

### 五、基金的面值

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

### 六、本基金与目标 ETF 的联系和区别

本基金的目标 ETF 为深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证基本面 60ETF”）。

本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别。

1、在基金的投资方法方面，深证基本面 60ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接方法，通过将绝大部分基金财产投资于深证基本面 60ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

2、在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖深证基本面 60ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎深证基本面 60ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金与深证基本面 60ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：

1、法律法规对投资比例的要求。深证基本面 60ETF 作为一种特殊的基金

品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。

2、申购赎回的影响。深证基本面 60ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

#### 七、募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

#### 八、募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金自 2011 年 8 月 8 日至 2011 年 9 月 2 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七章第（一）条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

#### 九、募集对象

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

#### 十、募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点向投资者公开发售。

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

#### 十一、认购安排

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

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

3、认购原则和认购限额：认购以金额申请。投资者认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项，投资者可以多次认购本基金份额，认购费率按单笔认购金额计算。

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

本基金基金合同已于 2011 年 9 月 8 日生效。

## 十二、认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，具体费率结构如下表所示：

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

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

## 十三、认购份数的计算

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

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

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

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

认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

## 十四、认购的方法与确认

### 1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金

管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

## 2、认购确认

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

## 十五、募集资金利息的处理方式

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

计算结果按照四舍五入方式，保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

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

净认购金额=10000/（1+1.2%）=9881.42 元

认购费用=10000-9881.42=118.58 元

认购份额=（9881.42+5）/1.00=9886.42 份

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

## 十六、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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

## 十七、募集结果

截至 2011 年 9 月 2 日，基金募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为人民币 928,119,630.57 元。本次募集所有认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 102,043.57 元。本次募集有效认购户数为 17,121 户，按照每份基金份额

初始面值人民币 1.00 元计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计 928,221,674.14 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次募集所有资金已全额划入本基金在基金托管人中国民生银行股份有限公司开立的建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管专户。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

1、基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金份额持有人数不少于 200 人，同时本基金目标 ETF 符合基金合同生效实质要件的前提下，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。本基金合同已于 2011 年 9 月 8 日生效。

3、本基金基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金基金合同生效后折成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转成基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### 二、基金募集失败时的处理方式

1、基金募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。



## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括本基金管理人和本基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。销售机构名单和联系方式见上述第五章第（一）条。

基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及时间

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

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

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间起开始办理申购。

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间起开始办理赎回。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

本基金已于 2011 年 10 月 14 日起开始日常赎回业务，已于 2011 年 10 月 14 日起开始办理日常申购业务。

### 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以前撤销。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回的申请方式

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

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

#### 2、申购与赎回申请的确认

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

#### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者资金账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构及相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人资金账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金基金合同有关条款处理。

### 五、申购与赎回的数额限制

1、本基金代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为 10 元人民币，

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

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

3、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。具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 六、申购费率与赎回费率

### 1、A类基金份额申购费、赎回费

(1) 本基金A类基金份额对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过1.5%。

本基金的A类基金份额申购费率如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.7%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

本基金A类基金份额收取申购费用并由A类基金份额申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) 本基金A类基金份额具体赎回费率如下表所示：

持有期限（Y）	赎回费率
持有期 < 7 日	1.5%
7 日 ≤ 持有期 < 1 年	0.5%

1 年≤持有期<2 年	0.3%
持有期≥2 年	0%

本基金 A 类基金份额的赎回费用由 A 类基金份额赎回人承担，对持续持有期少于 7 日的 A 类基金份额投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持有期长于 7 日的 A 类基金份额所收取的赎回费，赎回费中 25% 归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。（注：1 年指 365 天）

## 2、C 类基金份额申购费、赎回费、销售服务费

### （1）C 类基金份额申购费

本基金 C 类基金份额申购费率为 0。

### （2）C 类基金份额赎回费

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限（Y）	费率
Y < 7 日	1.5%
7 日 ≤ Y < 30 日	0.5%
Y ≥ 30 日	0

赎回费用全额进入基金财产。赎回费用由基金赎回人承担

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒介公告。

## 七、申购份数与赎回金额的计算方式

### 1、本基金申购份额的计算：

#### （1）A 类基金份额

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + A 类基金份额申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

#### （2）C 类基金份额

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值。

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

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

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

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

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

## 2、本基金赎回金额的计算：

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

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额净值}$$

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

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

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

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

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

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

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

## 3、本基金基金份额净值的计算：

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

## 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 八、申购与赎回的注册登记

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

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

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### 九、巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销者外，延迟至下一

开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

若本基金发生巨额赎回、在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权对于该基金份额持有人当日超过上一日基金总份额 20%以上的那部分赎回申请进行延期办理，对于该基金份额持有人其余赎回申请部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定通过指定媒介或代销机构的网点刊登公告。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

#### 十、拒绝或暂停申购的情形及处理

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常运转；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- （3）所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （4）所投资的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌；
- （5）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况，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暂停接受基金申购申请；
- （6）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （7）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- （8）申购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、单一投资人累计持有份额上限的情形；

(9) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。

#### 十一、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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

(1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(5) 所投资的目标 ETF 暂停赎回；

(6) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况，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暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应按规定向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，延续期限不得超过 20 个工作日，并在指定媒介公告。投资者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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停赎回公



告。

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，并依照有关规定在指定媒介上公告。

## 十二、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

## 十三、基金转换

1、基金转换是指本基金管理人旗下的开放式基金持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为本基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他开放式基金的份额。

### 2、基金转换业务规则

(1) 本基金管理人旗下基金办理日常转换的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本基金管理人公告暂停申购或转换时除外）。

由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，各销售机构办理基金转换业务的具体时间段及其他有关信息等事项，请以各销售机构的规定为准。

(2) 基金转换只能在同一销售机构进行。

(3) 转入的基金份额持有期自该部分基金份额登记于注册登记系统之日起开始计算。转入的基金在赎回或转出时，按照自基金转入确认日起至该部分基金份额赎回或转出确认日止的持有时段所适用的赎回费率档次计算其所应支付的赎回费。基金转换后可赎回的时间为 T+2 日。

(4) 基金转换，以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用“份额转换”的原则提交申请。基金转换遵循“先进先出”的原则。

(5) 投资者办理基金转换业务时，转出的基金必须处于可赎回状态，转入的基金必须处于可申购状态，已冻结的基金份额不得申请基金转换。

(6) 单笔转换基金份额不得低于 1000 份。

### 3、基金转换费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转

出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担，如转出基金有赎回费用的，收取该基金赎回费的 25% 归入基金财产。

基金转换费用的具体计算公式如下：

$$(1) \text{ 转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

(2) 转入金额：

A. 如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率，

转入金额 = 转出金额 × (1 - 转出基金赎回费率) / (1 + 转入基金申购费率 - 转出基金申购费率)

B. 如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率，

转入金额 = 转出金额 × (1 - 转出基金赎回费率)

$$(3) \text{ 转换费用} = \text{转出金额} - \text{转入金额}$$

$$(4) \text{ 转入份额} = \text{转入金额} / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

例：某客户将 10,000 份建信货币市场基金转换成本基金（假设本基金当日基金份额净值为 1.05 元）。建信货币的基金份额净值为 1 元，无累计未付收益。

因建信货币市场基金的赎回费率为 0%，申购费率为 0%，转入金额对应的本基金申购费率为 1.5%，则：

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日份额净值 = 10,000 × 1 = 10,000 元

转入金额 = 转出金额 × (1 - 转出基金赎回费率) / (1 + 转入基金申购费率 - 转出基金申购费率) = 10,000 × (1 - 0%) / (1 + 1.5% - 0%) = 9852.22 元

转换费用 = 转出金额 - 转入金额 = 10,000 - 9852.22 = 147.78 元

转入份额 = 转入金额 / 转入基金份额净值 = 9852.22 / 1.05 = 9383.07 份

即在上述情形下，该投资者将 10,000 份建信货币市场基金转换为本基金，经过注册登记机构确认后，投资者需要支付转换费用 147.78 元，转换后获得本基金基金份额为 9383.07 份。

4、本基金于 2012 年 3 月 22 日开始办理基金转换业务。

#### 十四、定期定额投资计划

基金定投，是指投资者通过本公司指定的基金销售机构提交申请，约

定每期扣款时间和扣款金额，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

#### （1）申购费率的说明

定投业务的申购费率、计费方式与日常申购费率、计费方式相同。对于在销售机构费率优惠期或通过本公司网上交易平台提交的定投业务申请，可适用不同的申购费率。具体实施的费率以销售机构当时有效的业务规定或相关公告为准。

#### （2）办理时间

定投业务的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购业务受理时间相同。具体办理规则请遵循销售机构的相关规定。

#### （3）投资金额

投资者可到各销售机构申请开办基金定投业务并约定每期扣款时间及固定的投资金额，该投资金额即为申购金额。具体申购金额限制，以各销售机构有关规定为准，但每期申购金额不得低于人民币 100 元（含 100 元）。

#### （4）交易确认

每期实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日（T 日）的基金份额净值为基准计算申购份额，申购份额将在 T+1 工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户内。基金份额确认查询和赎回起始日为 T+2 工作日。

为使您及时掌握定投申请的确认结果，请投资者在 T+2 工作日起到各销售机构查询确认结果。

投资者在本基金开放赎回后，可以在交易时间内随时办理基金的赎回。如无另行公告，本业务已申购份额的赎回及赎回费率等同于正常的赎回业务。赎回时遵循“先进先出”规则。

### 十五、基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”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的情形；

“司法执行”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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按照《业务规则》的有关规定办理。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金将绝大部分基金资产投资于目标 ETF，密切跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 二、标的指数和目标 ETF

#### （一）标的指数

深证基本面 60 指数

#### （二）编制方案

##### 1、样本空间

指数样本空间由满足以下条件的深市证券组成：

（1）上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来的日均总市值在全部沪深市场证券中排在前 30 位；

（2）非 ST、\*ST 证券。

##### 2、选样方法

（1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；

（2）对样本空间内剩余证券计算其基本面价值（FV）。单个证券的基本面价值计算方法如下：

（2.1）以过去 5 年的年报数据计算以下 4 个基本面指标：

营业收入：公司过去 5 年营业收入的平均值；

现金流：公司过去 5 年现金流的平均值；

净资产：公司在定期调整时的净资产；

分红：公司过去 5 年分红总额的平均值。

（2.2）若一公司可用年报数据少于 5 年，那么按可用年限的数据计算基本面指标；

（2.3）计算每只证券单个基本面指标占样本空间所有证券这一指标总和的百分比；

营业收入占样本空间所有证券营业收入总和的百分比；

现金流占样本空间所有证券现金流总和的百分比；

净资产占样本空间所有证券净资产总和的百分比；

分红占样本空间所有证券分红总和的百分比。

（2.4）基本面价值由上述 4 个百分比数据的简单算术平均值乘以 10,000,000 得出。

（3）将（2）中剩余证券按照基本面价值由高到低排名，选取排名在前 60 名的证券作为深证基本面 60 指数的样本。

### （三）指数信息查询

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

### （四）目标 ETF

本基金的目标 ETF 为深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（简称“深证基本面 60ETF”）。

## 三、投资范围

本基金以目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）及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），该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

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。

## 四、投资理念

基于基本面加权的指数化投资将以较低的成本获得市场平均水平的长期回报。

## 五、目标 ETF 的投资

本基金的目标 ETF 为深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金，经 2011 年 7 月 14 日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1092 号文核

准募集。

目标 ETF 投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

目标 ETF 的投资范围、投资策略等内容以目标 ETF 的基金合同和招募说明书列示为准。

## 六、投资业绩比较基准

本基金以深证基本面 60 指数为标的指数。若本基金标的指数发生变更，则本基金业绩比较基准随之改变。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证基本面 60 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ 。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。但下文“目标 ETF 的变更”另有约定的除外。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人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。

## 七、投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，

年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 1、资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，先保留现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，然后主要通过一级市场将剩余的大部分资产投资于目标 ETF 并使该投资比例不低于基金资产净值的 90%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

如因目标 ETF 及股票停牌限制、目标 ETF 及股票流动性不足、基金申购或赎回等基金管理人之外的因素，致使本基金各类资产的投资比例在上述范围之外，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，依法进行处理和调整。

### 2、目标 ETF 投资策略

#### （1）基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于目标 ETF，现时目标 ETF 指深证基本面 60ETF。

#### （2）基金组合的构建方法

本基金可通过成份股实物形式在一级市场申购及赎回目标 ETF 份额；本基金可在二级市场上买卖目标 ETF 份额，本基金在二级市场上买卖目标 ETF 份额仅出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，而不以套利为目的。

#### （3）基金组合的调整

本基金为 ETF 联接基金，基金所构建的 ETF 投资组合将根据目标 ETF 的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

### 3、成份股投资策略



### （1）股票组合的构建原则

成份股组合的构建主要是基金经理根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，以抽样复制法构建组合。

### （2）股票组合的构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化为目标进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上，采用重点抽样的方法，选择标的指数的成份股构建股票投资组合。

### （3）股票组合的调整

#### A. 定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

#### B. 不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大不利的司法诉讼、或者基金管理人充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

## 4、债券投资策略

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

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例，并灵活地采用收益率曲线方法、品种选择方法等构建有效的固定

收益类证券组合。

#### 5、权证投资策略

本基金可根据法律法规规定，并基于谨慎原则运用权证对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资权证必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

#### 6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金跟踪误差的来源包括：留存现金及债券部分、成份股和备选成份股的投资、基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、股息的再投资策略等。

基金管理人将通过对上述因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。本基金每日跟踪基金组合与基准表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与基准表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，及时优化跟踪偏离度管理方案。

### 八、投资管理体制及流程

#### 1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、追踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

#### 2、投资流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制。

### （1）研究分析

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

### （2）投资决策

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

基金经理根据标的指数，结合研究报告，原则上依据指数成份股的权重构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将根据投资决策委员会确定的投资组合调整方案采取适当的方法调整组合，以降低交易成本、控制投资风险。对于超出权限范围的投资，基金经理按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

### （3）交易执行

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

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

### （4）投资回顾

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

## 九、基金的风险收益特征

本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证

券投资基金中较高风险—收益的品种。

## 十、投资限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的和指定的目标 ETF 除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但是指定的目标 ETF 除外；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

### 2、投资组合限制

基金管理人运用基金财产进行证券投资，遵守下列限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- （2）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- （3）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%；
- （4）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；
- （5）同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产

比例不高于基金资产净值的 5%；

（6）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；

（7）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；

（8）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

（9）本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

（10）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（11）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（12）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；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基

金不受上述规定的限制。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

除上述第（4）、（6）、（11）、（12）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。

#### 十一、目标 ETF 的变更

当出现以下情形时，基金管理人可以在履行适当的程序后变更本基金所联接的目标 ETF，与原目标 ETF 有类似投资目标的 ETF 作为新的目标 ETF：

- （1）目标 ETF 的基金合同终止；
- （2）目标 ETF 与其他基金进行合并；
- （3）目标 ETF 变更标的指数；
- （4）目标 ETF 的基金管理人或基金托管人发生变更；
- （5）中国证监会规定的其他情形。

#### 十二、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- （1）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- （2）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；
- （3）有利于基金财产的安全与增值；
- （4）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。

#### 十三、基金的投资组合报告

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020

年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

## 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,439,931.83	2.04
	其中：股票	12,439,931.83	2.04
2	基金投资	559,566,350.00	91.61
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	37,560,554.49	6.15
8	其他资产	1,224,285.53	0.20
9	合计	610,791,121.85	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	313,675.62	0.05
B	采矿业	78,300.00	0.01
C	制造业	7,291,745.60	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,268.80	0.02
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	303,082.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	121,800.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,376.68	0.00
J	金融业	1,651,980.32	0.27
K	房地产业	2,250,438.09	0.37
L	租赁和商务服务业	302,235.60	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,439,931.83	2.05

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	45,535	1,275,890.70	0.21
2	000333	美的集团	13,559	984,383.40	0.16
3	000651	格力电器	17,012	906,739.60	0.15
4	000001	平安银行	42,582	645,968.94	0.11
5	000858	五粮液	2,000	442,000.00	0.07
6	000725	京东方A	84,500	414,895.00	0.07
7	000100	TCL科技	64,000	393,600.00	0.06
8	000338	潍柴动力	25,500	385,050.00	0.06
9	300498	温氏股份	16,053	313,675.62	0.05
10	001979	招商蛇口	18,036	273,245.40	0.05

## 4、报告期末按券种分类的债券投资组合

无。

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

无。

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

无。

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

无。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细

无。

## 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十名基金投资



## 明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	深 F60ETF	股票型指数基金	交易型开放式 (ETF)	建信基金管理有限责任公司	559,566,350.00	92.20

## 10、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

无。

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 11、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

无。

## (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## (3) 本期国债期货投资评价

无。

## 12、投资组合报告附注

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

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3) 其他资产的构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	429,763.80
2	应收证券清算款	25,508.26
3	应收股利	-
4	应收利息	3,826.37
5	应收申购款	765,187.10

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,224,285.53

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

(6) 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，分项之和与合计可能有尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2020 年 9 月 30 日。

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

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 1、深 60 联接 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年9月8日—2011年12月31日	-13.59%	0.93%	-17.25%	1.32%	3.66%	-0.39%
2012年1月1日—2012年12月31日	2.28%	1.30%	2.12%	1.31%	0.16%	-0.01%
2013年1月1日—2013年12月31日	-7.66%	1.38%	-7.61%	1.39%	-0.05%	-0.01%
2014年1月1日—2014年12月31日	51.73%	1.22%	50.64%	1.23%	1.09%	-0.01%
2015年1月1日—2015年12月31日	18.11%	2.38%	17.27%	2.41%	0.84%	-0.03%
2016年1月1日—2016年12月31日	-4.67%	1.26%	-2.96%	1.29%	-1.71%	-0.03%
2017年1月1日—2017年12月31日	41.67%	0.90%	39.44%	0.92%	2.23%	-0.02%
2018年1月1日—2018年12月31日	-22.21%	1.44%	-24.02%	1.46%	1.81%	-0.02%
2019年1月1日—2019年12月31日	51.46%	1.31%	48.90%	1.34%	2.56%	-0.03%
2020年1月1日—2020年9月30日	8.82%	1.61%	6.70%	1.63%	2.12%	-0.02%
自基金合同生效起—2020年9月30日	153.27%	1.45%	125.27%	1.48%	28.00%	-0.03%

## 2、深 60 联接 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起—2018 年 12 月 31 日	-6.84%	1.52%	-7.07%	1.54%	0.23%	-0.02%
2019 年 1 月 1 日-2019 年 12 月 31 日	51.76%	1.32%	48.90%	1.34%	2.86%	-0.02%
2020 年 1 月 1 日-2020 年 9 月 30 日	8.41%	1.61%	6.70%	1.63%	1.71%	-0.02%
自基金合同生效起—2020 年 9 月 30 日	53.27%	1.46%	47.64%	1.48%	5.63%	-0.02%

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金财产的构成

基金资产总值是指本基金拥有的包括目标 ETF 份额在内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。

其构成主要有：

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

### 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

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册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、基金财产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而

取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销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。

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

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、估值日

基金资产估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、目标 ETF 估值方法：

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

#### 2、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值。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了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；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最

近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去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或证券发行机构发生了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；

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

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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

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

4、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

5、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

6、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7、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。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值信息。因此，就与本基金有关的会



计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金淨值信息的計算結果對外予以公布。

#### 四、估值對象

基金所擁有的目標 ETF 份額、股票、債券、權證和銀行存款本息等資產和負債。

#### 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人進行。基金管理人完成估值後，將估值結果以電子或者加蓋公章的書面形式加密發送至基金託管人，基金託管人按法律法規、《基金合同》規定的估值方法、時間、程序進行複核，複核無誤後在基金管理人傳真的書面估值結果上加蓋業務公章或者以電子簽名確認的方式返回給基金管理人；月末、年中和年末估值複核與基金會計賬目的核對同時進行。

#### 六、基金份額淨值的確認和估值錯誤的處理

各類基金份額淨值的計算保留到小數點後 4 位，小數點後第 5 位四舍五入。當估值或份額淨值計價錯誤實際發生時，基金管理人應當立即糾正，並採取合理的措施防止損失進一步擴大。當錯誤達到或超過基金份額淨值的 0.25% 時，基金管理人應報中國證監會備案；當估值錯誤偏差達到基金份額淨值的 0.5% 時，基金管理人應當公告，並報中國證監會備案。因基金估值錯誤給投資者造成損失的，應先由基金管理人承擔，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

關於差錯處理，本合同的當事人按照以下約定處理：

##### 1、差錯類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人、或註冊登記機構、或代理銷售機構、或投資者自身的過錯造成差錯，導致其他當事人遭受損失的，過錯的責任人應當對由於該差錯遭受損失的當事人（“受損方”）按下述“差錯處理原則”給予賠償承擔賠償責任。

上述差錯的主要類型包括但不限於：資料申報差錯、數據傳輸差錯、數據計算差錯、系統故障差錯、下達指令差錯等；對於因技術原因引起的差錯，若系同行業現有技術水平無法預見、無法避免、無法抗拒，則屬不可抗力，按照下述規定執行。

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

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已发生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### 七、暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、基金所投资之目标ETF发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形；

3、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

5、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，基金管理人经与基金托管人协商确认后，暂停基金估值时；

6、中国证监会认定的其他情形。

## 八、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

## 第十三部分 基金的收益分配

### 一、基金收益的构成

在本基金《基金合同》项下，基金收益即基金利润是指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金收益减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、收益分配原则

1、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 4 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%；

2、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别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、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分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及截至该日的可供分配利润、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）

的时间不超过 15 个工作日。

#### 六、收益分配中发生的费用

收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

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

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- (1)、基金管理人的管理费；
- (2)、基金托管人的托管费；
- (3)、C 类基金份额的基金销售服务费；
- (4)、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5)、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (6)、基金份额持有人大会费用；
- (7)、基金的证券交易费用；
- (8)、基金的银行汇划费用；
- (9)、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提基金管理费。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假

日、公休假等, 支付日期顺延。

### （2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下, 按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数, 则取 0）的 0.1% 年费率计提基金托管费。计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分; 若为负数, 则 E 取 0。

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

### （3）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 0.5%。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人与基金托管人核对一致后, 基金托管人依据与基金管理人约定的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率, 此项调整不需要召开基金份额持有人大会, 但基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 个工作日在指定媒介公告并报中国证监会备案。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—9 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。

## 二、基金销售时发生的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中的相关规定。本基金申购费、赎回费的费率水平、计算方式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的相关规定。不同基金间转换的转换费，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确定并公告。

## 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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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、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会计责任方。

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度。

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、会计制度执行国家有关会计制度。

5、本基金独立建账、独立核算。

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金年度审计

1、本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和基金托管人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。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

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内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。

### 一、公开披露的基金信息

#### 1、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

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在指定网站上。

（1）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。

（2）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。

（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。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## 4、基金净值信息公告

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在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的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

## 5、基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人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。

## 6、基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

(1) 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，将年度报告登载在指定网站上，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；

(2) 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，并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；

（3）基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，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。

基金运作期间，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基金定期报告“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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 7、临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上：

- （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）变更目标 ETF；
- （5）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；
- （6）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；
- （7）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （8）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；

- （9） 基金募集期延长或提前结束募集；
- （10） 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；
- （11） 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；
- （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） 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- （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缓支付赎回款项；
- （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） 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- （22） 基金推出新业务或服务；
- （23） 中国证监会规定的其他事项。
- （24） 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调整基金份额类别设置；

#### 8、澄清公告

在本基金基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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。

## 9、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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

## 10、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。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。

## 11、中国证监会规定的其他信息

### 二、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公司住，供社会公众查阅、复制。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

三、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请（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）超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以 1.00 元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至 1.00 元初始面值或 1.00 元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，



但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

#### （一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。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，而宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

#### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影

响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金的流动性风险主要体现为基金申购、赎回等因素对基金造成的流动性影响。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### （1）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，同时本基金基于分散投资的原则在行业和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。

#### （2）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或部分延期赎回。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或延缓支付赎回款项的措施。

#### （3）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。

#### （四）信用风险

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

#### （五）投资本基金的特有风险

##### 1、目标 ETF 的风险

本基金为ETF联接基金，主要投资对象是目标ETF，因此目标ETF面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

##### 2、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。

##### 3、标的指数波动的风险

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

##### 4、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，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

（1）本基金 90%以上的净资产投资于目标 ETF，目标 ETF 回报与标的指数回报的偏离会造成本基金与标的指数的跟踪偏离；

（2）本基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致本基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度；

（3）受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标 ETF 份额和成份股、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将目标 ETF 份额和成份股及时地转化为现金，使得本基金在跟踪标的指数时存在一定的跟踪偏离风险；

（4）在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对于指数基金的管理能力，例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出证券的时机选择

等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金相对于对标的指数的偏离程度。

5、本基金为目标 ETF 的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生差异的原因包括以下几个方面：

（1）本基金赎回采用现金方式，为支付现金赎回款，相比目标 ETF，本基金需要保留更多的现金资产；

（2）本基金申购采用现金方式，在利用到账的申购资金投资目标 ETF 过程中，市场波动等原因会造成本基金与目标 ETF 表现的差异；

（3）本基金为应对现金申购赎回而进行的证券交易需支付一定的手续费，此等费用将影响本基金相对于目标 ETF 的表现。

#### 6、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，或者编制机构退出市场，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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 7、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。在极端情况下，成份股中停牌股票的比例可能比较大，由于停牌股票在停牌期间的流动性受限，无法立即变现，可能会导致本基金的流动性风险增加。

#### （六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等

方面的不完善产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

## 第十八部分 基金的终止与清算

### 一、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》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。

### 二、基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

（1）基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7）聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （8）将基金清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金清算报告；
- （10）对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告，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。

### 6、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

### 一、基金合同当事人的权利与义务

#### （一）基金管理人

##### 1、基金管理人的权利

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）依法募集基金；
- （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）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律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、委托、更换基金代销机构，对基金代销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注册登记机构办理基金注册登记业务；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）在符合有关法律规法规和基金合同的前提下，制订和调整相关业务规则，决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- （13）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；
- （14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融



资、融券；

（15）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；

（16）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（17）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

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）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议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；

（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

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内发出，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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

（23）基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实

施其他法律行为；

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供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。

（二）基金托管人

1、基金托管人的权利

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收入；

（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）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）按规定取得基金份额持有人名册资料；

（10）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- （4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，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）建立并保存基金份额持有人名册；
- （13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（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，应为基金利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### （三）基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同募集的基金份额，即成为本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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1、基金份额持有人的权利

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；

(5) 出席或者委派代表出席本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会，对本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

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) 遵守基金合同；

(2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7) 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

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 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) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，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。

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。

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 40 天，在指定报刊和指定网站上公告。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、方式和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- （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）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （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，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见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书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（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或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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书委派代表出席，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及身份证明、受托出席会议者身份证明及其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书符合法律法规、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利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 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（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书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### （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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额

10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

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日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

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

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

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（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 50%以上（含 50%）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）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

#### （2）通讯开会

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 50%以上（含 50%）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。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，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，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）基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布选举三名监票人，其中至少有两名监票人从出席会议的基金份额持有人和代理人中选举产生。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

#### （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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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）本基金的基金份额持有人出席目标 ETF 的份额持有人大会并参与表决的特别约定

鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的份额持有人大会并参与表决，其在目标 ETF 份额持有人大会上享有表决权的基金份额称为目标 ETF 参会份额。本基金基金份额持有人所持每份目标 ETF 参会份额对应目标 ETF 的一票表决权，参会份额数的计算方法为：目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日当日，本基金持有目标 ETF 份额占本基金基金资产的比例乘以该持有人所持有的本基金份额数（计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位）。

（十）法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

#### （一）基金管理人和基金托管人职责终止的情形

##### 1、基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）被依法取消基金管理资格；
- （2）被基金份额持有人大会解任；
- （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

##### 2、基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- （1）被依法取消基金托管资格；
- （2）被基金份额持有人大会解任；
- （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；

(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

### 1、基金管理人的更换程序

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过；

(3) 临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

(4) 核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行；

(5) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(6) 交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；

(7) 审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；

(8) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。

### 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过，新任基金托管人应当符合法律法

规及中国证监会规定的资格标准；

（3）临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

（4）核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行；

（5）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；

（6）交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；

（7）审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

### 3、基金管理人与基金托管人的同时更换

（1）提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

（2）基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

（3）公告：新任基金管理人和新任基金托管人应当依照有关规定予以公告并报中国证监会备案。

4、新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

## 四、基金托管

基金财产由基金托管人保管。基金托管人和基金管理人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。

订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安



全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 五、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、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止基金合同；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，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：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （6）除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自该决议生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 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）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，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合同终止并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。

### 六、基金份额的注册登记

#### （一）基金注册登记业务

本基金的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

#### （二）基金注册登记业务办理机构

本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

#### （三）基金注册登记机构的权利

基金注册登记机构享有以下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

4、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；

5、法律法规规定的其他权利。

#### （四）基金注册登记机构的义务

基金注册登记机构承担以下义务：

1、配备足够的专业人员办理本基金份额的注册登记业务；

2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的注册登记业务；

3、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；

5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、法律法规规定的其他义务。

#### 七、违约责任

（一）因基金合同当事人的违约行为造成基金合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属基金合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等；

2、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等；

3、不可抗力。

（二）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为

给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。

（三）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

#### 八、争议的处理

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

基金合同受中国法律管辖。

#### 九、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

3、基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

#### 十、其它事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商

解决。

## 第二十部分 托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：孙志晨

设立日期：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 2 亿元

存续期限：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司（简称：中国民生银行）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

法定代表人：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币 28,365,585,227 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及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股、新股（首次发行或增发等，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券以及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）。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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人对基金投融资比例进行监督的内容包括但不限于：《基金合同》约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例符合《基金法》及相关法律法规规定、《基金合同》约定的时间要求、法规允许投资比例调整期限等。

1、按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金以目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）及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），该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

2、根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；

（2）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%；

（3）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；



（4）同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%；

（5）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；

（6）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；

（7）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；

（8）本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

（9）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（11）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；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

### 3、法规允许的基金投资比例调整期限

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。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。

除上述第（3）、（5）、（10）、（11）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。

### 3、法规允许的基金投资比例调整期限

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。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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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。

### 4、本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

### 5、相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本协议第十五条基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生

生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、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。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。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，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，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。本基金投资银行存款的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。本基金的存款的核心银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，

对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（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，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前2个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施

进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

6、基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据或者出现其他影响基金托管人履行托管人监督职责的行为，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应承担相应法律后果，包括但不限于承担基金托管人可能遭受的监管部门罚款以及基金托管人向基金份额持有人承担的赔偿。因投资流动受限证券产生的损失，除依据法律法规的规定以及《基金合同》的约定应当由基金托管人承担的之外，基金托管人不承担上述损失。如因基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求的原因导致本基金出现风险损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。法律法规及监管机构另有规定的除外。

（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中违反法律法规和《基金合同》的规定，应及时以书面形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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

（九）基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提

示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规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）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 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和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（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》、本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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人重大违规行为，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。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集资金的验资和入账

- 1、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，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金托管专户中，并确保实收基金金额与验资确认金额相一致。
- 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事宜。

## （三）基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金托管专户，用于基金交易的资金清算和保管基金的银行存款。基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进

行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人负责。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他与本基金无关的任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

#### （四）基金证券账户和证券交易资金账户的开设和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开设和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或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、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，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，结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开设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。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管账户的开设和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市



场债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行进行报备。

2、同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应共同负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理，法律法规另有规定的从其规定。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。由基金管理人移交托管人保管的实物证券，基金管理人对其合法性和真实性负责。基金托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间发生损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

#### （八）与基金有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应在合同签署后 5 个工作日内通过专人

送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额。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，国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应于每个开放日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他有关法律法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并电子或加盖公章的书面形式加密发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章或者以电子签名确认的方式返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。

3、基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人、基金托管人共同承担。本基金的会计责任方是基金管理人，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，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

### （二）基金资产估值方法

基金的估值对象为基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、目标 ETF 估值方法：

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值。

#### 2、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近一个交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大

事件的，以最近一个交易日的市价（收盘价）估值；如最近一个交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近一个交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近一个交易日的收盘价估值。如最近一个交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近一个交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近一个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。如最近一个交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

### 3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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

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

4、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

5、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。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、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7、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。

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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。

### （三）估值差错处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。如基金托管人在复核基金份额净值时已发现基金管理人计算错误，但由于无法与基金管理人就基金份额净值计算结果协调一致而导致的基金份额净值计算错误结果的，基金托管人免责。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记

机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

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

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

## 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托

管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### （四）基金账册的建账和对账

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

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。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净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）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明原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3、财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束后 15 个工作日内完成季度报告编制；在会计年度半年结束后两个月内完成基金中期报告的编制；在会计年度结束后三个月内完成基金年度报告编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

双方核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。

#### 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利

登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由注册登记机构和基金管理人共同保管。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不少于 15 年，本协议另有规定的除外。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于次月开始后的前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### （二）基金托管协议终止的情形

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

### （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) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (3) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估值和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金清算公告；
- (10) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算的公告

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备证券、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《基金合同》终止并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。

（六）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。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

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

一、客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）

1、自助语音服务

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

2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至每周五，9：00~17：00 的人工电话咨询服务。

3、客户留言服务

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

二、订制对账单服务

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

1、电子邮件对账单

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

2、短信对账单

短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电

子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信对账单服务的持有人发送短信对账单。

### 3、纸质对账单

如投资者因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服热线 400-81-95533（免长途话费）按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，将 15 个工作日内为投资者免费邮寄纸质对账单。

## 三、网站服务（www.ccbfund.cn）

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

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

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷地下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

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

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

## 四、短信服务

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

## 五、电子邮件服务

若投资者准确完整的预留了电子邮箱地址，可获得免费电子邮件服务，包括产品信息、公司最新公告等。未预留电子邮箱地址的投资者可拨

打客服电话或登录公司网站添加后订制此项服务。

#### 六、微信服务

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

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

#### 七、密码解锁/重置服务

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

#### 八、客户建议、投诉处理

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

## 第二十二部分 其他应披露事项

自 2019 年 10 月 26 日至 2020 年 10 月 25 日，本基金的临时公告刊登于《上海证券报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 等规定媒介。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加民商基金销售（上海）有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-09-18
2	关于新增华西证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-09-18
3	建信基金管理有限责任公司关于新增中国人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-08-22
4	建信基金管理有限责任公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-07-29
5	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
6	建信基金管理有限责任公司关于新增阳光人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-05
7	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
8	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加渤海银行基金申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-26
9	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08
10	建信基金管理有限责任公司关于旗下 117 只基金基金合同及招募说明书（更新）提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2019-12-31
11	关于建信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分证券投资基金基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-12-31
12	建信基金管理有限责任公司旗下基金改聘会计师事务所的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-11-13
13	关于新增上海联泰基金销售有限公	指定报刊和/或	2019-11-12

	司为建信消费升级等基金代销机构的公告	公司网站	
--	--------------------	------	--

投资者可通过《上海证券报》和基金管理人网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 等规定媒介查阅上述公告。

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

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公司住，供社会公众查阅、复制。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 第二十四部分 备查文件

1、中国证监会核准建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

2、《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

3、《建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

4、关于申请募集建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金之法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇二一年三月