

建信基金管理有限责任公司

建信中证物联网主题交易型开放式指数  
证券投资基金  
托管协议

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

鉴于建信基金管理有限责任公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；

鉴于中信建投证券股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的证券公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；

鉴于建信基金管理有限责任公司拟担任建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人，中信建投证券股份有限公司拟担任建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金托管人；

为明确建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

## 一、托管协议当事人

### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：建信基金管理有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

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

成立时间：2005年9月19日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会、中国证监会证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

(二) 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2005]112 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 76.46 亿元

基金托管资格批文及文号：证监许可【2015】219 号

存续期间：持续经营

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

## 二、托管协议的依据、目的、原则和解释

### (一) 依据

本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》及其他有关法律、法规与《建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下

简称“《基金合同》”)订立。

## (二) 目的

订立本协议的目的是明确建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金托管人和建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金管理人之间在基金财产的保管、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。

## (三) 原则

基金管理人和基金托管人本着平等自愿、诚实信用的原则,经协商一致,签订本协议。

## (四) 解释

除非文义另有所指,本协议的所有术语与《基金合同》的相应术语具有相同含义。

## 三、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对基金管理人的下列投资运作进行监督:

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国

证监会的相关规定)。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## 2、对基金投融资比例进行监督。

(1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;

(2) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;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%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

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

(4) 本基金参与股指期货交易,依据下列标准建构组合:

①在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;

②在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

③在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

④在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

⑤本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑥每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（5）本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

（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）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（8）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%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（9）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合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；

（10）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；

（11）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

②参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；

③最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

④证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(12) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

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

(14) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(3)、(9)、(10)、(11)项外，因证券/期货市场波动、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等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

(二) 基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，完善业务流程，有效防范和控制风险。基金托管人将对基金参与出借业务进行监督和复核。

(三) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露中登载基金业绩表现数据等进行复核。

(四) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人

违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（五）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（六）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

#### **四、基金管理人**对**基金托管人**的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的托管账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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。

2、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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在上述规定限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在上述规定限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

## 五、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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的托管账户、证券账户和期货结算账户以及投资所需的其他专用账户。
- 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、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，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）中国注册会计师签章方为有效。
- 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账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。募集期间募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户。

### （三）基金的托管账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户，账户名称以实际开立为准。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

3、本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的托管账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金托管账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

#### （五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

5、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》

的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

6、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （六）债券托管账户的开设和管理

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；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，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和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## 六、指令的发送、确认及执行

### （一）基金管理人对发送指令人员的书面授权

1、基金管理人应当事先向基金托管人发出书面通知（以下称“授权通知”），载明基金管理人被授权人的名单、签章样本、权限、期限和预留印鉴。授权通知的文件应由基金管理人加盖公章。

2、基金管理人向基金托管人发送授权通知后，应及时与基金托管人通过电

话确认，以保证基金托管人及时查收。授权通知自基金托管人确认收到授权通知后于授权通知载明的生效时间生效（如基金托管人收到授权通知的时间晚于授权通知载明的生效时间，则授权通知自基金托管人确认收到授权通知的时间生效，下同）。

3、基金管理人在与基金托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交基金托管人。基金管理人应确保授权通知的正本与扫描件或传真件一致。若授权通知正本内容与基金托管人收到的扫描件或传真件不一致的，以基金托管人收到的已生效的扫描件或传真件为准。

## （二）指令的内容

指令是基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及投资指令。基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字。相关登记结算公司向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管人发出的指令。

## （三）指令的发送、确认和执行

1、指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表基金管理人用传真的方式或其他双方确认的方式向基金托管人发送。基金管理人负有义务在发送指令后及时与基金托管人进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。对于指令发送人员发出的指令，基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，并且基金托管人已收到该通知，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，基金管理人不承担责任。

2、基金管理人应按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，基金管理人应及时电话通知基金托管人。

3、基金管理人发给基金托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、时间、金额、出款和收款账户信息等。基金托管人在接收指令时，应对指令的要素是否齐全、印鉴是否与授权通知相符等进行表面一致性的检查，对合法合规的指令，基金托管人应在规定期限内执行，不得有合理延误。基金托管人有权要求基金管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保基金托管人有足够的

资料来判断指令的有效性。基金管理人应保证所提供的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或虚假、误导性陈述；基金托管人对此类文件资料仅进行形式审查，对其真实性和有效性不作实质性判断，不承担任何责任。

如果基金管理人发出的指令要素不全或含义模糊的，基金托管人有权不执行，并附注相应的说明后立即将指令退还给基金管理人，由此引起的任何后果或责任，基金托管人概不承担。

4、基金管理人在发送指令时，应为基金托管人执行指令留出 2 个工作小时的执行指令时所必需的时间。指令传输不及时未能留出足够的执行时间等基金管理人原因，致使指令未能及时执行所造成的损失由基金管理人承担。

#### （四）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形主要包括：指令要素错误、指令要素不全或含义模糊，无投资行为的指令、预留印鉴错误等情形。

基金托管人发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。由此引起的任何后果或责任，基金托管人概不承担。

对基金管理人更正并重新发送后的指令经基金托管人核对确认后方能执行。

#### （五）基金托管人依照法律法规拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律法规规定或者《基金合同》约定，应当不予执行，并及时通知基金管理人要求其变更或撤销相关指令，若基金管理人在基金托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，基金托管人应当拒绝执行，并向中国证监会报告。

基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金的银行存款账户有足够的资金余额，确保基金的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，基金托管人可不予执行，但应及时通知基金管理人，由此造成的损失，由基金管理人承担。

#### （六）基金托管人未按照基金管理人指令执行的处理方法

基金托管人因未正确执行基金管理人合法合规的指令，致使本基金的利益受

到损害，基金托管人应承担直接损失的赔偿责任。除此之外，基金托管人对执行基金管理人的合法合规指令对基金造成的损失不承担任何责任。

#### （七）被授权人及授权权限的变更

基金管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前 1 个工作日通知基金托管人；修改授权通知的文件应由基金管理人加盖公章。基金管理人对于授权通知的修改应当以传真的形式发送给基金托管人，同时向基金托管人电话确认。基金管理人对于授权通知的内容的修改自与基金托管人电话确认后于通知载明的生效时间起生效。基金管理人此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件正本送交基金托管人。若授权通知修改的正本内容与基金托管人收到的扫描件或传真件不一致的，以基金托管人收到的已生效的扫描件或传真件为准。

#### （八）相关的责任

基金托管人正确执行基金管理人符合本协议约定、合法合规的划款指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因导致未能及时或正确执行符合本协议约定、合法合规的划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但托管账户及其他账户余额不足或基金托管人遇到不可抗力等非可归责于托管人原因的情况除外。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本协议相关规定验证有关印鉴与签名无误，基金托管人不承担因正确执行有关指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由基金管理人承担。

### 七、交易及清算交收安排

#### （一）基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券经营机构。

##### 1、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据相关标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议，并按照法律法规的规定向中国

证监会报告。基金管理人应将交易单元租用协议的原件及时送交基金托管人。

## 2、相关信息的通知

基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金专用交易单元的号码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况，其中交易单元租用应至少在首次进行交易的 10 个工作日前通知基金托管人，交易单元退租应在次日内通知到基金托管人。

3、基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。

## (二) 基金清算交收

1、因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交收，由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。

2、由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。基金管理人同意在发生以上情形时，基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

3、由于基金管理人或基金托管人原因导致基金无法按时支付清算款时，责任方应对由此给基金财产造成的损失承担相应的赔偿责任。

4、基金管理人应保证在交收日（T+1 日）12:00 前基金托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足则基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

5、基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金托管账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间。对于要求当天到账的指令，应在当天 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。

对于中国证券登记结算有限责任公司实行T+0非担保交收的业务，基金管理

人应在交易日14:00将划款指令发送至基金托管人。

因基金管理人指令传输不及时,致使资金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司所造成的损失由基金管理人承担,包括赔偿在深圳市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中国证券登记结算有限责任公司深圳公司最低备付金带来的利息损失。在基金资金头寸充足的情况下,基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得以不合理拖延或拒绝执行。

### (三) 资金、证券账目和交易记录核对

基金管理人和基金托管人应对本基金的资金、证券账目及交易记录进行核对。

### (四) 基金申购、赎回业务处理的基本规定

1、基金管理人和基金托管人应当按照《基金合同》、《招募说明书》的约定,在基金申购、赎回的时间、场所、方式、程序、价格、费用、收款或付款等各方面相互配合,积极履行各自的义务,保证基金的申购、赎回工作能够顺利进行。

2、申购赎回发生的现金替代款、现金差额、现金替代的退款和补款由基金管理人按相关业务规则及合同办理。对于基金申购、赎回过程中产生的应收款,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,到账日应收款没有到达银行托管账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收,由此给基金造成损失的,基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。拨付净应付款时,如基金银行托管账户有足够的资金,基金托管人应按时拨付;因基金银行托管账户没有足够的资金,导致基金托管人不能按时拨付,托管人不承担责任;如系基金管理人的原因造成,责任由基金管理人承担,基金托管人不承担垫款义务。

## 八、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、基金份额净值是按照每个估值日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。



2、基金管理人应每个估值日对基金财产估值。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》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的基金资产净值和基金份额净值，以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。所造成的误差不作为基金财产估值错误处理。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；当错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，通知基金托管人，并报中国证监会备案。基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，并导致基金财产或基金份额持有人的实际损失的，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制单位或

登记机构等机构发送的数据错误等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,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减轻或消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异,且双方经协商未能达成一致,以基金管理人的意见为准,基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布,基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## (二) 基金会计核算

### 1、基金账册的建立

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

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符,双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后5个工作日内完成;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规定网站上;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。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告;中期报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于上半年结束之日起两个月内予以公告;年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于在每年结束之日起三个月内予以公告。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。

基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供给基金托管人复核;基

金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以双方认可的账务处理方式为准;若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上签章确认,或出具签章版复核意见书,双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

## 九、基金收益分配

### (一) 基金收益分配的依据

收益分配应该符合《基金合同》关于收益分配原则的规定。

### (二) 基金收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人根据《基金合同》的相关规定制定。

2、基金管理人应于收益分配日之前将其制定的收益分配方案提交基金托管人复核,基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核,并将复核意见书面通知基金管理人,复核通过后基金管理人应当将收益分配方案依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告;如果基金管理人与基金托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致,基金托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明提交中国证监会备案并书面通知基金管理人,在上述文件提交完毕之日起基金管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案,且基金托管人有义务协助基金管理人实施该收益分配方案,但有证据证明该方案违反法律法规

及《基金合同》的除外。

3、本基金收益分配方式为现金分红。

4、基金托管人根据基金管理人的收益分配方案和提供的现金分红金额的数据，在红利发放日将分红资金划入基金管理人指定账户。

## 十、基金信息披露

### （一）保密义务

基金管理人和基金托管人除为履行法律法规、《基金合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的基金的信息，并且应当将基金的信息限制在为履行前述义务而需要了解该信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：

1、非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

2、基金管理人和基金托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。

### （二）基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、基金管理人和基金托管人应根据相关法律法规、《基金合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。基金管理人和基金托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

2、本基金信息披露的所有文件，包括《基金合同》和本协议规定的定期报告、临时报告、基金净值信息及其他必要的公告文件，由基金管理人和基金托管人按照有关法律法规的规定予以公布。

3、基金年度报告中的财务会计报告必须经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

4、本基金的信息披露，应通过中国证监会规定媒介进行；基金管理人、基金托管人可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规

定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

## 5、信息文本的存放与备查

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所和基金上市交易的证券交易所网站，供社会公众查阅、复制。基金管理人、基金托管人应为文本存放、基金份额持有人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

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。

6、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- (1) 不可抗力；
- (2) 发生暂停估值的情形；
- (3) 法律法规、基金合同或中国证监会认定的其他情况。

## (三) 基金托管人报告

基金托管人应按《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》和其他有关法律法规的规定于每个上半年度结束后 60 日内、每个会计年度结束后 90 日内在基金中期报告及年度报告中分别出具托管人报告。

# 十一、基金费用

## (一) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月第 3 个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具管理费划款指令。若遇法定

节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## （二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月第 3 个工作日从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具托管费划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（三）从基金财产中列支基金管理人的管理费、基金托管人的托管费之外的其他基金费用，应当依据有关法律法规、《基金合同》的规定执行。

（四）对于违反法律法规、《基金合同》、本协议及其他有关规定（包括基金费用的计提方法、计提标准、支付方式等）的基金费用，不得从任何基金财产中列支。

## 十二、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册；

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

(二) 基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

(三) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

### 十三、基金有关文件档案的保存

(一) 基金管理人应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，基金托管人应保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限为 15 年。

(二) 基金管理人和基金托管人应按本协议第十条的约定对各自保存的文件和档案履行保密义务。

### 十四、基金托管人和基金管理人的更换

(一) 基金管理人职责终止后，仍应妥善保管基金管理业务资料，并与新任基金管理人或临时基金管理人及时办理基金管理业务的移交手续。基金托管人应给予积极配合，并与新任基金管理人或临时基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值。

(二) 基金托管人职责终止后，仍应妥善保管基金财产和基金托管业务资料，

并与新任基金托管人或临时基金托管人及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续。基金管理人应给予积极配合，并与新任基金托管人或临时基金托管人核对基金资产总值和基金资产净值。

(三) 其他事宜见《基金合同》的相关约定。

## 十五、禁止行为

(一) 《基金法》禁止的行为。

(二) 《基金法》禁止的投资或活动。

(三) 除根据基金管理人的指令或《基金合同》、本协议另有规定外，基金托管人不得动用或处分基金财产。

(四) 基金管理人、基金托管人的高级管理人员和其他从业人员不得相互兼职。

(五) 法律法规、《基金合同》和本协议禁止的其他行为。

法律法规或监管部门调整上述限制的，本基金从其规定。

## 十六、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

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

(二) 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；



- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 十七、违约责任和责任划分

（一）如果基金管理人或基金托管人不履行本托管协议或者履行本托管协议不符合约定的，应当承担违约责任。

（二）因托管协议当事人违约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，一方承担连带责任后有权根据另一方过错程度向另一方追偿。但是发生下列情况的，当事人免责：

- 1、不可抗力；
- 2、基金管理人和/或基金托管人按照届时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；
- 3、基金管理人由于按照基金合同规定行使或不行使其投资权而造成的损失等。
- 4、基金托管人由于按照基金管理人符合基金合同约定的有效指令执行而造成的损失等；
- 5、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由商业银行、证券公司等其他机构负责清算交收的委托资产（包括但不限于保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原

因给委托资产带来的损失等。

（三）如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为给基金财产或基金投资者造成损失，另一方当事人（“守约方”）有权利代表基金对违约方进行追偿；如果由于违约方的违约行为导致“守约方”赔偿了该基金财产或基金投资者所遭受的损失，则守约方有权向违约方追索，违约方应赔偿和补偿守约方由此发生的所有成本、费用和支出，以及由此遭受的损失。

（四）托管协议当事人违反托管协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任。

（五）当事人一方违约，守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。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（六）违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。

（七）由于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或未能避免错误发生的，由此造成基金财产或基金投资者损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（八）本协议所指损失均为直接经济损失。

## 十八、适用法律与争议解决方式

各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费和律师费由败诉方承担。

争议处理期间，本协议当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不含台湾、香港、澳门地区）并从其解释。

## 十九、托管协议的效力

（一）基金管理人在向中国证监会申请基金募集注册时提交的基金托管协议草案，应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权签字人签字或盖章并加盖公章，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。

（二）本协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。本协议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备案并公告之日止。

（三）本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本协议正本一式六份，协议双方各执两份，上报中国证监会和中国银行保险监督管理委员会各壹份，每份具有同等法律效力。

## 二十、托管协议的签订

见签署页。

(以下无正文)

本页无正文，为《建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的签字盖章页。

基金管理人：建信基金管理有限责任公司（公章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

基金托管人：中信建投证券股份有限公司（公章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签订地点：北京

签订日期：二〇二一年 月 日