

建信中证全指证券公司交易型开放式  
指数证券投资基金发起式联接基金  
招募说明书（更新）

2023 年第 1 号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中信证券股份有限公司

二〇二三年七月

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2021 年 5 月 26 日证监许可[2021]1841 号文准予注册。本基金的基金合同于 2021 年 9 月 9 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金及目标 ETF 基金的特定风险，跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务等潜在风险等。

本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证全指证券公司指数，其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，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、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。投资者承诺不使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本基金。

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不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2023 年 5 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 3 月 31 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	3
第二部分	释义	4
第三部分	基金管理人	10
第四部分	基金托管人	19
第五部分	相关服务机构	23
第六部分	基金的募集	36
第七部分	基金合同的生效	42
第八部分	基金份额的申购与赎回	44
第九部分	基金的投资	56
第十部分	基金的业绩	69
第十一部分	基金的财产	71
第十二部分	基金资产估值	72
第十三部分	基金的收益与分配	78
第十四部分	基金费用与税收	80
第十五部分	基金的会计与审计	83
第十六部分	基金的信息披露	84
第十七部分	侧袋机制	92
第十八部分	风险揭示	95
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	103
第二十部分	《基金合同》的内容摘要	105
第二十一部分	《托管协议》的内容摘要	123
第二十二部分	对基金份额持有人的服务	146
第二十三部分	其他应披露事项	148
第二十四部分	招募说明书的存放及查阅方式	149
第二十五部分	备查文件	150

## 第一部分 前言

《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国民法典》、《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2号——基金中基金指引》、《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《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（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中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司

3、基金托管人：指中信证券股份有限公司

4、基金合同：指《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告：指《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 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

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会发布的《关于修改部分证券期货规章

的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许

购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

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

26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为建信基金管理有限责任公司或接受建信基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构

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

29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《建信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

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

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

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

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

46、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

47、元：指人民币元

48、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值



51、**基金份额净值**：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、**基金资产估值**：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

53、**规定媒介**：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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

54、**ETF、目标 ETF**：指另一经中国证监会注册的交易型开放式证券投资基金，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。本基金选择建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“建信中证全指证券公司 ETF”）为目标 ETF

55、**交易型开放式证券投资基金联接基金（以下简称“ETF 联接基金”）**：指将绝大部分基金资产投资于跟踪同一资产价格的 ETF，紧密跟踪资产的表现，追求跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

56、**发起式基金**：指符合中国证监会有关规定，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

57、**发起资金**：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额合计不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

58、**发起资金提供方**：指包括以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

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

60、**摆动定价机制**：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份

额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

62、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

63、基金份额类别：指根据认购/申购费用、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

64、A类基金份额：指在投资人认购/申购时收取认购/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

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

66、销售服务费：指从基金财产中计提的，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

67、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

68、基金产品资料概要：指《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新

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

## 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（简称“建信基金管理公司”）

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：刘军

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

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

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

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由8名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由5名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

暂由张军红总裁代为履行董事长职务。

张军红先生，执行董事，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，现任建行消费金融公司筹备组副组长。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、建行消费金融公司筹备组副组长。

赵乐峰先生，董事，现任信安金融集团中国区助理副总裁。1989年毕业于美国堪萨斯州（恩波里拉）州立大学企管财经专业硕士。历任中国信托商业银行（中国台湾）业务规划副主管，华信银行（中国台湾）零售金融主管，荷银光华投信（中国台湾）总经理特别助理，富邦投信（中国台湾）营销企划及银行渠道主管、英国保诚投信（中国台湾）营销长、卜峰正大集团中国区副总经理、银华基金管理公司市场总监、诺亚财富控股公司首席投资策略师、建信基金管理公司总裁特别助理。

陈惠燕女士，董事，现任信安亚洲区财务总监。1993年毕业于新加坡南洋理工大学，获学士学位。2001年毕业于悉尼理工大学，获硕士学位。2002年至2021年，在英国保诚集团旗下翰亚投资公司工作，历任亚洲总部财务部经理、财务部高级经理、财务部副总监和财务总监。

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

何杏森女士，监事，2018 加入信安国际香港，现任信安国际（亚洲）有限公司大中华地区首席法律顾问。1996 年获香港大学法学学士学位，2004 年获美国杜克大学法学硕士学位。拥有香港、英格兰和威尔斯以及美国纽约州律师从业资格。曾任职香港证券及期货事务监察委员会法规执行部，其后在富兰克林邓普顿、骏利资产管理、荷兰银行、瑞士信贷（香港）、柏瑞投资亚洲有限公司、嘉实国际资产管理等多家金融机构担任法律顾问及法务部主管。

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。

王涛先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司交易部总经理，学士学位。曾任长盛基金管理有限公司业务运营部基金会计。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，交易部执行总经理、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。

姜黎女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司财务管理部副总经理。2005年7月毕业于中央财经大学金融学专业，获硕士学位。曾任普华永道会计师事务所高级审计员。2008年5月加入建信基金管理公司，历任基金运营部财务管理专员，财务管理部财务主管、资深财务专员、总经理助理、副总经理。

### 3、高级管理人员

张军红先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张力铮先生，副总裁。1988年7月加入中国建设银行，先后在总行建筑经济部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部、集团客户部等部门工作，2012年6月起历任建行北京市分行党委委员、副行长，总行投资托管业务部副总经理，公司业务部副总经理等职务。2023年2月加入建信基金管理公司，任党委委员，2023年3月17日起任副总裁。

宫永媛女士，副总裁，博士。2001年7月加入中国建设银行，先后在建总行个人银行业务部、个人金融部、个人存款与投资部任职，2015年11月起任个人存款与投资部资深副经理。2018年6月加入建信基金管理公司，任纪委书记、党委委员，2022年12月至今任党委委员，2023年2月17日起任建信基金管理有限责任公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入建信基金管理公司，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，2017年11月起任党委委员。

### 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

龚佳佳先生，硕士。曾任诺安基金管理有限公司数量投资部研究员、基金经理助理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部量化研究员；华夏基金管理有限公司数量投资部研究员、投资经理。2018年5月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理等职务。2019年2月22日至2023年2月1日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；2019年3月7日至2022年5月5日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板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；2019年8月23日起任建信沪深300红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020年3月6日至2023年1月5日任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020年4月17日至2021年4月6日任建信中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020年6月29日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年2月18日至2022年9月29日任建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年3月11日起任建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年5月27日起任建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年6月3日至2022年5月11日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经理；2021年7月15日起任建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年7月29日起至2021年12月27日任建信中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年8月19日起任建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021年9月8日起任建信沪深300红利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；2021年9月9日起任建信中证全指证券公司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；2021年11月25日起任建信中证饮料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022年1月7日起任建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022年7月21日起任建信中证农牧主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

## 6、投资决策委员会成员

张军红先生，总裁。

陈正宪先生，总裁特别助理。

梁洪昀先生，数量投资部总经理。

叶乐天先生，数量投资部副总经理。

朱金钰先生，数量投资部副总经理。

薛玲女士，数量投资部副总经理。

姜华先生，数量投资部高级基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其它职责。

### 四、基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；



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

### 3、基金经理承诺

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

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

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

(4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

### 五、基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制的原则

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

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

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

(4) 有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对其工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

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

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

#### 2、内部控制的主要内容

### （1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。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

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）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：中信证券股份有限公司（简称：中信证券）

注册地址：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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

成立日期：1995年10月25日

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：14,820,546,829元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：95548-3

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）成立于1995年10月25日，前身是中信证券有限责任公司。中信证券于2003年1月6日在上海证券交易所挂牌上市，并于2011年10月6日在香港联交所上市交易。

根据中国证监会核发的经营业务许可证，公司经营范围包括：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

2014年7月中信证券成立托管部，并于当年10月收到中国证监会《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044号），获得证券投资基金托管资格。开展基金托管业务以来，公司严格切实履行基金托管人职责，维护基金投资人的合法权益。中信证券逐年加大托管业务信息技术系统建设投入，构建智能化客户服务体系，持续研发创新基金托管服务。

#### 2、主要人员情况

中信证券设立托管部，管理并具体承办基金托管业务。托管部下设市场服务、产品设计、估值核算、托管结算、投资监督、跨境服务、客户服务、金融科技、

风险管理、综合管理等团队。部门员工均具备证券投资基金从业资格，并具有多年金融从业经历，核心业务岗人员均已具备5年及以上相关业务经验。截至2022年12月31日，部门员工共计166人，具备3年以上托管业务相关从业经验的占80%以上。

吴俊文女士，现任中信证券托管部行政负责人；西安电子科技大学计算机及应用学学士，2000年7月至2014年7月，担任中信证券清算部执行总经理，主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作，2014年7月起任中信证券托管部行政负责人。

### 3、基金托管业务经营情况

中信证券于2014年10月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来，秉承“忠于所托，信于所管”的宗旨，严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定，依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队，切实履行资产托管人职责，为基金管理人和投资者提供安全、高效、专业的托管服务。

#### （二）托管业务的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

中信证券托管业务运行严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成运作流程化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，确保托管资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益，保障托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部控制原则

（1）合法合规原则：内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终；

（2）完整性原则：托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的岗位和人员；

（3）有效性原则：建立对内控制度及其执行的监督、评价、反馈和完善机制，保证内控制度有效执行；

（4）审慎性原则：托管业务各项业务活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产的安全与完整；

（5）预防性原则：必须树立“预防为主”的管理理念，控制风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生；

（6）及时性原则：内部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；

（7）独立性原则：托管人托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价小组必须独立于内控制度的制定和执行小组；

（8）相互制约原则：托管部的内部机构和岗位设置应当权责分明、相互制衡；

### 3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规的规定，中信证券制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管业务的规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全以及高效。

主要制度包括《中信证券证券投资基金托管业务管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务内部控制和风险管理办法》、《中信证券公开募集证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务保密工作管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务会计核算业务管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务清算管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务投资监督管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务资产保管管理办法》、《中信证券基金托管业务从业人员管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。通过这些规章制度的建立和实施，做到业务分工合理、业务运行和操作流程化、技术系统完整独立、核心业务相互隔离以及有关信息披露由专人负责，以便勤勉尽责的履行托管义务。

托管业务内部控制的内容主要涉及托管项目、资产保管、资金清算、会计核算和资产估值、投资监督、信息技术系统等重要业务环节的内部控制。基金托管人通过对基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制。同时为了保证和验证内部控制的有效性、完整性，中信证券定期聘请具有证券业务资格的专业会计师事务所，针对基金托管业务的内

部控制制度建设与实施情况，开展相关审查与评估，出具评估报告。

托管业务内部控制的主要措施包括：不相容职务分离控制、授权审批控制、财产保护控制、会计系统控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。

### （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

#### 1、监督方法

基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过监控系统，对各基金投资运作比例等控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，通知基金管理人，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并根据具体情况及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作情况，编写托管人年度报告，对各基金投资运作的合法合规性等方面进行评价。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人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：刘军

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

##### （2）网上交易平台

投资者可以通过基金管理人网上交易平台办理基金的认购、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基金管理人网站查询。基金管理人网址：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

#### 2、其他销售机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：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）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

办公地址：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

传真：0755-83195109

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



（3）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

（4）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：盛超

客户服务热线：95055-4

网址：<https://www.duxiaoman.com/>

（5）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：400-619-9059

网址：<http://www.hcfunds.com/>

（6）北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

客户服务热线：010-66154828

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

（7）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：<https://www.yibaijin.com>

（8）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：戴彦

客户服务热线：95357

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

（9）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：<http://www.puyifund.com/>

（10）凤凰金信(海口)基金销售有限公司

注册地址：海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园E区4层

法定代表人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

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

（11）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：<https://www.gomefund.com/>

（12）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：<https://www.ehowbuy.com/>

（13）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号楼5楼503

法定代表人：温丽燕

客户服务电话：4000-555-671

网址：<https://www.hgccpb.com/>

（14）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：章知方

客户服务电话：400-920-0022

网址：<https://www.licaike.com/>

（15）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

客户服务电话：400-618-0707

网址：<https://www.hongdianfund.com/>

（16）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/>

（17）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：<https://www.chinapnr.com/>

（18）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/>

（19）京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

法定代表人：邹保威

客户服务热线：95518

（20）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

网址：<http://www.66zichan.com/>

（21）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：<https://www.lufunds.com/>

（22）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：王珺

客户服务电话：95188-8

网址：<http://www.fund123.cn/>

（23）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：[www.msftec.com](http://www.msftec.com)

（24）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：<https://www.snjijin.com/>

（25）诺亚正行基金销售有限公司

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：<https://www.noah-fund.com/>

（26）深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

法定代表人：杨柳

客户服务电话：400-680-3928

网址：<https://www.simuwang.com/>

（27）上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室

法定代表人：马金

客户服务热线：021-60608989

（28）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/>

（29）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：李兴春

客户服务热线：400-921-7755

网址：<http://www.leadbank.com.cn/>

（30）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：<https://wacaijijin.com/>

（31）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：<http://www.windmoney.com.cn/>

（32）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/>

（33）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：400-1818-188

网址：<https://fund.eastmoney.com/>

（34）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：<http://www.5ifund.com/>

（35）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：<https://www.buyforyou.com.cn/>

（36）喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人：王舰正

客户服务电话：400-6997-719

网址：<https://www.xiquefund.com/>

（37）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：穆飞虎

客户服务热线：010-6267 5369

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

（38）玄元保险代理有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

客户服务电话：400-080-8208

网址：<https://www.licaimofang.cn/>

（39）北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客户服务热线：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com/>

（40）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路 7 号楼 20 层 20A1、20A2 单元

法定代表人：才殿阳

客户服务热线：400-609-9200

网址：<http://www.yixinfund.com/>

（41）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/>

（42）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：<https://www.yingmi.cn/>

（43）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：<http://www.erichfund.com/>

（44）北京中植基金销售有限公司

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：武建华

客户服务电话：400-786-8868

网址：<https://www.chtfund.com/>

（45）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：<https://www.zlfund.cn/>，<http://www.jjmmw.com/>

（46）泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206

法定代表人：彭浩

客户服务热线：400-004-8821

网址：<https://www.taixincf.com>

（47）博时财富基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

法定代表人：王德英

客户服务热线：400-610-5568

网址：<https://www.boserawealth.com/>

（48）上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号



法定代表人：栗旭

客户服务热线：400-168-1235

网址：<https://www.luxxfund.com/>

（49）上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室

法定代表人：许欣

客户服务热线：400-100-2666

网址：<https://www.zocaifu.com/>

（50）中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

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

（51）中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：陈佳春

客服热线：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

（52）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：95548

网址：<http://www.gzs.com.cn>

（53）中信期货有限公司

地址：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

客服电话：400 9908 826

网址：<http://www.citicsf.com>

（54） 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（55） 长城证券有限责任公司

住所：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：张巍

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

（56） 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

（57） 长江证券股份有限公司

住所：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

（58） 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：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

公司网址：www.csc108.com

（59） 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

（60）渤海证券股份有限公司

注册地址：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：安志勇

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（61）信达证券股份有限公司

注册地址：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

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（62）平安证券股份有限公司

地址：深圳市金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：何之江

客服热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

（63）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

（64）东吴证券股份有限公司

地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：95330

网址：<http://www.dwzq.com.cn/>

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的其他销售机

构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

## 二、基金份额登记机构

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

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：刘军

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：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

联系人：陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

## 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 2021 年 5 月 26 日证监许可[2021]1841 号文注册。

### 二、基金的类别

ETF 联接基金

### 三、基金的运作方式

契约型开放式、发起式

### 四、基金的投资目标

通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 五、目标 ETF

建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

### 六、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 1000 万份，最低募集金额为 1000 万元人民币，其中使用基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员资金认购基金的金额合计不少于 1000 万元人民币。

发起资金提供方承诺持有发起资金认购的基金份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响。

### 七、基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

### 八、基金存续期限

不定期

### 九、基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为

不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/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，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金有关基金份额类别的具体设置以及费率水平等由基金管理人确定，并在本招募说明书中公告。根据基金销售情况，在符合法律法规及中国证监会规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率或者停止现有基金份额类别的销售等，或对基金份额分类办法及规则进行调整，而无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告。

#### 十、本基金与目标 ETF 的联系与区别

在投资方法和交易方式等方面，本基金与目标 ETF 的联系与区别主要体现在以下几个方面：

##### 1、联系：

（1）两只基金跟踪同一个标的指数即中证全指证券公司指数及其未来可能发生的变更；

（2）两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；

（3）两只基金具有相似的风险收益特征；

（4）目标 ETF 是本基金的主要投资对象。

##### 2、区别：

（1）投资方法不同：目标 ETF 主要投资于标的指数的成份股和备选成份股，紧密跟踪标的指数；而本基金采用间接的投资方法，通过将绝大部分资产投资于目标 ETF，实现对标的指数的紧密跟踪。

（2）交易方式不同：投资人既可以像投资股票一样在证券交易所买卖目标 ETF，也可以按照最小申购赎回单位和申赎清单的要求，申购赎回目标 ETF；而本基金则像普通开放式基金一样，通过基金管理人和其他销售机构按未知价法进行基金的申购赎回。

#### 十一、本基金与目标 ETF 业绩表现的差异

本基金的业绩表现与目标 ETF 的业绩表现可能会出现差异，差异产生的主要原因有以下几个方面：

1、投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

2、现金比例及现金管理方式的不同，会导致两只基金的业绩有差异。目标 ETF 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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的 5%。

#### 十二、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 十三、发售方式

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

#### 十四、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

#### 十五、认购安排

1、认购时间：本基金向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人同时发售，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、投资人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。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额缴付认购款项，投资人可以多次认购本基金份额。其他销售机构每个基金交易账户每次认购金额不得低于 10 元人民币，其他销售机构另有规定最低单笔认购金额高于 10 元的，从其规定。本基金管理人直销柜台、网上交易平台每个基金交易账户首次认购金额不得低于 10 元人民币，单笔追加认购最低金额为 10 元人民币。

4、募集期内，基金管理人可设置单个投资人的累计认购金额限制，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

5、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

#### 十六、认购费用

募集期投资人可以多次认购本基金，认购费用按累计认购金额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。基金投资人认购本基金基金份额时收取认购费用。

本基金 A 类基金份额的认购费率如下表所示。

认购金额（M）	认购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M<200万元	1.00%
200万元≤M<500万元	0.60%
M≥500万元	每笔1,000元

本基金 C 类基金份额不收取认购费用。

基金认购费用由认购本基金基金份额的投资人承担，不列入基金财产。认购费用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。

#### 十七、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

#### 十八、基金认购份额的计算



基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。基金份额的认购份额计算方法为：

（1）认购费用适用比例费率时，计算方法为：

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

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

（2）认购费用适用固定金额时，计算方法为：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资 5 万元认购本基金 A 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则可得到的基金认购份额为：

$$\text{净认购金额} = 50,000 / (1 + 1.20\%) = 49,407.11 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (49,407.11 + 5) / 1.00 = 49,412.11 \text{ 份}$$

即：某投资人投资 5 万元认购本基金 A 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到 49,412.11 份本基金基金份额。

例：某投资人投资 5 万元认购本基金 C 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则可得到的 C 类认购份额为：

$$\text{认购份额} = (50,000 + 5) / 1.00 = 50,005.00 \text{ 份}$$

即：某投资人投资 5 万元认购本基金 C 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到 50,005.00 份本基金 C 类基金份额。

## 十九、认购申请的确认

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

## 二十、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。

#### 二十一、发起资金的认购

本基金发起资金认购的金额不少于 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于 3 年。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

#### 二十二、募集结果

截止 2021 年 9 月 3 日，本基金募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所验资，本次募集有效认购户数为 1,001 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，设立募集期募集及利息结转的基金份额共计 18,875,401.15 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方认购基金的总金额不少于 1,000 万元人民币，且承诺发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果目标 ETF 募集失败或募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效满三年后的对应日，若本基金资产净值低于两亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，若连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管

理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公告。基金投资人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。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算；

- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项时，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇目标 ETF 的投资市场休市、暂停交易或延迟交收、目标 ETF 暂停交易或赎回、目标 ETF 延迟支付赎回对价、交易清算规则发生较大变化、证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购

或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项将退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 五、申购和赎回的数量限制

1、其他销售机构每个基金交易账户单笔申购最低金额为10元人民币，其他销售机构另有规定最低单笔申购金额高于10元的，从其规定；本基金管理人直销柜台每个基金交易账户首次最低申购金额、单笔追加申购最低金额均为10元人民币；通过本基金管理人网上交易平台申购本基金时，单笔申购最低金额为10元人民币。

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

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

4、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人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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回

份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用。C 类基金份额不收取申购费用。投资人可以多次申购本基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。

(1) 本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

费用种类	申购金额（M）	申购费率
申购费率	M < 100 万元	1.50%
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
	M ≥ 500 万元	每笔 1,000 元

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，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) 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、赎回费

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，并按照持有期限的不同将赎回费按照不同比例计入基金财产，赎回费用的其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

(1) A 类基金份额赎回费

本基金 A 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限（N）	费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 30 日	0.50%
N ≥ 30 日	0



投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对于持有期少于 7 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期 7 日以上（含 7 日）的基金份额所收取的赎回费，将不少于赎回费用的 25% 归入基金财产。

## （2）C 类基金份额赎回费

本基金 C 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限（N）	费率
N < 7 日	1.50%
N ≥ 7 日	0

收取的赎回费用全额归入基金财产。

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

4、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率并另行公告。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费）。

A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

（1）申购费用适用比例费率时，计算方法为：

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

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

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

（2）申购费用为固定金额时，计算方法为：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

C 类基金份额申购份额的计算方式如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=50,000/（1+1.50%）=49,261.08 元

申购费用=50,000-49,261.08=738.92 元

申购份额=49,261.08/1.0500=46,915.31 份

即：投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 46,915.31 份 A 类基金份额。

例：某投资人投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05 份

即：投资人投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

在基金份额持有人赎回本基金份额时收取赎回费用，基金份额持有人的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回总金额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 20 日，赎回适用费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.50\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,480 - 57.40 = 11,422.60 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 20 日，赎回适用费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的赎回金额为 11,422.60 元。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设持有期大于 7 天，则赎回适用费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0 = 0 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,480 - 0 = 11,480.00 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，持有期大于 7 天，赎回适用费率为 0，则可得到的赎回金额为 11,480.00 元。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 5、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

7、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；

8、所投资的目标 ETF 暂停申购、暂停上市、二级市场交易停牌或达到或接近申购上限；

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

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述（第 4 项除外）暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

5、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

6、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；

7、所投资的目标 ETF 暂停赎回、暂停上市、二级市场交易停牌、延缓支付赎回对价或达到、接近赎回上限时；

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

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金

管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）若本基金发生巨额赎回的，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权延期办理赎回申请：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，有权全部进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”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。

（4）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### 十四、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十五、定期定额投资计划

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

#### 十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照法律法规及国家有权机关的要求以及基金登记机构业务规定来处理。

#### 十七、基金份额的转让

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

## 十八、其他业务

在相关法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 二、投资范围

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、衍生工具（股指期货、股票期权）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金成立以后还可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资。

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。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

### 三、标的指数及其编制信息

#### （一）标的指数

中证全指证券公司指数

#### （二）编制方案

##### 1、样本空间

指数样本空间同中证全指指数样本空间。

## 2、选样方法

（1）将样本空间证券按中证行业分类方法分类；

（2）如果行业内证券数量少于或等于 50 只，则全部证券作为相应全指行业指数的样本；

（3）如果行业内证券数量多于 50 只，则分别按照证券的日均成交金额、日均总市值由高到低排名，剔除成交金额排名后 10%、以及累积总市值占比达到 98%以后的证券，并且保持剔除后证券数量不少于 50 只；行业内剩余证券作为相应行业指数的样本。

### （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、投资策略

本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。

### （一）资产配置策略

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF，其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、衍生工具（股指期货、股票期权）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），其目的是为了为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避

免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## （二）基金投资策略

### 1、投资组合的构建

基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成目标 ETF，使本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

### 2、投资组合的投资方式

本基金投资目标 ETF 的两种方式如下：

（1）申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以组合证券进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF；

（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 的交易。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

## （三）成份股、备选成份股投资策略

本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

## （四）债券投资策略

本基金债券投资组合将着重考虑基金的流动性管理及策略性投资的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。债券投资者的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

## （五）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利

用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### （六）衍生金融产品投资策略

本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。

本基金投资股指期货将力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，以套期保值为目的，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

#### （七）融资及转融通证券出借策略

基金管理人遵守审慎经营原则运用基金财产参与转融通证券出借业务，加强转融通证券出借业务信用风险管理，分析市场情况、投资者类型与结构、历史申赎数据、出借证券流动性情况等因素，合理确定出借证券的范围、期限和比例，分散出借期限与借券证券公司的集中度。本基金通过约定申报方式参与出借业务的，基金管理人将对借券证券公司的偿付能力等进行尽职调查与准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，借券证券公司最近 1 年的分类结果应为 A 类。

为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。

### 五、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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；

（3）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%；

（4）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；

（5）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，有价证券指目标 ETF、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和目标 ETF 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%；

（6）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；

（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）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（9）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；

（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该比例限制的，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；

（12）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 50%；

③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

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

（13）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%；

（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。

因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符

合上述第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整；除上述第（1）、（4）、（10）、（11）、（12）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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制或禁止行为，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。

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%

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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止，但下文“目标ETF发生相关变更情形时的处理”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、风险收益特征

本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 八、目标ETF发生相关变更情形时的处理

若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。

若目标ETF触发终止运作的情形，或目标ETF因退市变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，则本基金将自动终止。上述情形可不召开基金份额持有



人大会，具体安排见基金管理人届时相关公告。

#### 九、基金管理人代表基金行使股东或债权人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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

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、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 十一、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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2023年3月31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	61,887.00	0.14
	其中：股票	61,887.00	0.14
2	基金投资	39,806,101.86	89.70

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,073,687.96	9.18
8	其他资产	435,519.51	0.98
9	合计	44,377,196.33	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	61,887.00	0.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	61,887.00	0.14

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601688	华泰证券	3,200	40,864.00	0.09
2	601696	中银证券	500	5,370.00	0.01
3	601066	中信建投	200	5,126.00	0.01
4	601555	东吴证券	200	1,382.00	0.00
5	600999	招商证券	100	1,379.00	0.00
6	600621	华鑫股份	100	1,158.00	0.00
7	600109	国金证券	100	896.00	0.00
8	600837	海通证券	100	881.00	0.00
9	601375	中原证券	200	744.00	0.00
10	601901	方正证券	100	697.00	0.00

### 4、报告期末按债券品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名的前五名债券投资明细

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名的前五名权证投资明细

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	建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	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	39,806,101.86	91.99

#### 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。

#### 10、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，招商证券股份有限公司（600999）于2022年9月20日发布公告，公司于2022年9月19日收到了中国证监会《行政处罚决定书》（〔2022〕50号）。招商证券作为中安科重大资产重组的独立财务顾问，履职过程中未勤勉尽责，导致出具的《独立财务顾问报告》存在误导性陈述，且后续在并购重组当事人发生较大变化对本次重组构成较大影响的情况时未能予以高度关注，未按照规定及时向中国证监会报告，违反了《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监会令第54号）（以下简称《财务顾问管理办法》）第三条、第十九条第四项、第二

十八条第五项之规定和 2005 年《证券法》第二十条第二款和第一百七十三条之规定，构成《财务顾问管理办法》第四十二条“财务顾问及其财务顾问主办人或者其他责任人员所发表的专业意见存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，中国证监会责令改正并依据《证券法》第二百二十三条的规定予以处罚”以及 2005 年《证券法》第二百二十三条“证券服务机构未勤勉尽责，所制作、出具的文件有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”所述情形。依据 2005 年《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会决定责令招商证券改正违法行为，没收业务收入 3150 万元，并处以 3150 万元罚款。

（2）基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,269.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	422,249.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	435,519.51

（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 2023 年 3 月 31 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

建信中证全指证券公司 ETF 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
自基金合同生效-2021年12月31日	-0.80%	0.92%	-5.19%	1.15%	4.39%	-0.23%
2022年1月1日-2022年12月31日	-24.19%	1.50%	-26.07%	1.58%	1.88%	-0.08%
2023年1月1日-2023年3月31日	3.92%	1.20%	4.11%	1.26%	-0.19%	-0.06%
自基金合同生效-2023年3月31日	-21.85%	1.36%	-27.02%	1.45%	5.17%	-0.09%

建信中证全指证券公司 ETF 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-2021年12月31日	-0.92%	0.92%	-5.19%	1.15%	4.27%	-0.23%

2022年1月1日—2022年12月31日	-24.50%	1.50%	-26.07%	1.58%	1.57%	-0.08%
2023年1月1日—2023年3月31日	3.81%	1.19%	4.11%	1.26%	-0.30%	-0.07%
自基金合同生效-2023年3月31日	-22.34%	1.36%	-27.02%	1.45%	4.68%	-0.09%

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的目标 ETF 份额、股票、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 第十二部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、股指期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 1、目标 ETF 基金份额的估值

本基金持有的目标 ETF 基金份额按估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。

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

②交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

④交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

⑤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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

⑥对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

##### 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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

②首次公开发行未上市的股票、债券，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在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票

等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

5、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。

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

7、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

8、本基金参与转融通证券出借业务的，将按法律法规或参照行业协会的相关规定进行估值。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计主责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍

无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金淨值信息的計算結果對外予以公布。

## 五、估值程序

1、各類基金份額淨值是按照每個估值日閉市後，該類基金資產淨值除以當日該類基金份額的餘額數量計算，精確到 0.0001 元，小數點後第五位四舍五入，由此產生的誤差計入基金財產。基金管理人可以設立大額贖回情形下的淨值精度應急調整機制。國家另有規定的，從其規定。

基金管理人於每個估值日計算基金資產淨值及各類基金份額淨值，並按規定公告。

2、基金管理人應每個估值日對基金資產估值。但基金管理人根據法律法規或基金合同的規定暫停估值時除外。基金管理人每個估值日對基金資產估值後，將基金資產淨值和各類基金份額淨值結果發送基金託管人，經基金託管人複核無誤後，由基金管理人按約定對外公布。

## 六、估值錯誤的處理

基金管理人和基金託管人將採取必要、適當、合理的措施確保基金資產估值的準確性、及時性。當基金份額淨值小數點後四位以內(含第四位)發生估值錯誤時，視為基金份額淨值錯誤。

基金合同的當事人應按照以下約定處理：

### 1、估值錯誤類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人、或登記機構、或銷售機構、或投資人自身的過錯造成估值錯誤，導致其他當事人遭受損失的，過錯的責任人應當對由於該估值錯誤遭受損失當事人(“受損方”)的直接損失按下述“估值錯誤處理原則”給予賠償，承擔賠償責任。

上述估值錯誤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。

### 2、估值錯誤處理原則

(1) 估值錯誤已發生，但尚未給當事人造成損失時，估值錯誤責任方應及時協調各方，及時進行更正，因更正估值錯誤發生的費用由估值錯誤責任方承擔；由於估值錯誤責任方未及時更正已產生的估值錯誤，給當事人造成損失的，由估

值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人及基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 七、暂停估值的情形

1、基金投资涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

4、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 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、由于不可抗力原因，或证券、期货交易所或登记结算公司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。

#### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；A 类和 C 类基金份额持有人可分别选择不同的分红方式；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

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

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。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在规定媒介上公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收

益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。



## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的基金销售服务费；
- 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、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金证券、期货的交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等）；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 2、基金托管人的托管费

基金托管人对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提基金托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或

基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计主责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，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。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，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》提示性公告登载在规定报刊上，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规定网站上，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网站上。

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介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及发起资金提供方持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

### （四）基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规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，通过规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资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。

### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情

形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管



业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

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、本基金发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项；

22、本基金变更目标 ETF；

23、本基金推出新业务或服务；

24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

25、调整基金份额类别设置；

26、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并按照《信息披露办法》予以公告。

#### （十）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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十一）基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十二）基金投资股票期权的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### （十三）基金投资资产支持证券的信息披露

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

#### （十四）投资于非公开发行股票等流通受限证券的信息披露

基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

#### （十五）参与融资与转融通证券出借业务的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资交易和参与转融通证券出借业务的情况，包括投资策

略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况等，并就报告期内本基金参与融资融券证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。

#### （十六）基金投资目标 ETF 的信息披露

本基金在定期报告和招募说明书（更新）中应设立专门章节披露所持目标 ETF 的相关情况并揭示相关风险：

- 1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；
- 2、交易及持有目标 ETF 产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，在招募说明书（更新）中列明计算方法并举例说明；
- 3、持有的目标 ETF 发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；
- 4、基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。

#### （十七）有关发起资金认购的基金份额的信息披露

基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求，在基金年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理持有基金份额、期限及期间的变动情况。

#### （十八）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

#### （十九）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、行政法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要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。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费和销售服务费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计

师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、市场风险

本基金投资于证券市场，由于整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响从而形成风险，主要包括：

#### 1、政策风险

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

#### 2、经济周期风险

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

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致债券市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及拟投资债券的融资成本和收益率水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

#### 4、购买力风险

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

#### 5、投资资产支持证券风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。本基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

#### 6、信用风险

信用风险指债券发行人或存款银行出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

#### 7、投资股指期货风险



本基金投资于股指期货。投资于股指期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来损失。

#### 8、投资股票期权的风险

股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。基金管理人为了更好的防范投资股票期权所面临的各类风险，建立了股票期权交易决策小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项。

#### 9、转融通证券出借风险

第一，流动性风险，本基金参与转融通证券出借业务后，当出现大额赎回时，基金将面临因为无法变现资产而无法应对赎回的风险。

第二，信用风险，本基金参与转融通证券出借业务可能会面临证券出借对手方到期不能归还所借证券，或不能补偿相应权益或费用的风险。

第三，市场风险，本基金参与转融通证券出借业务后，可能面临无法及时处置证券的市场风险。

### 二、基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

#### 1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。

#### 2、交易风险

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

### 3、运营风险

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

### 4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

## 三、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现在基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资人赎回款项的风险。

### 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为开放式基金，投资人可以在本基金的申购、赎回开放日申请申购或赎回本基金。但在极端的、特殊的市场情况下可能无法满足投资人的日常申购及赎回申请。如在接受申购、赎回申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响、基金资产估值存在重大不确定性等特殊情形时，可能无法满足投资人的申购、赎回申请。

本基金为 ETF 联接基金。在投资方向与投资比例方面，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%，与此同时，本基金严格控制流通受限资产的投资比例。开放式证券投资基金具有较高的流动性，在正常情况下，其每日开放申购、赎回的机制安排、分散化投资的制度安排等可以满足本基金日常的投资管理需要及应对赎回的资金调拨需求。

### 2、巨额赎回情形下的风险管理措施

在本基金发生巨额赎回情形时，可能出现包括但不限于暂停赎回、赎回申请比例确认、延期办理赎回申请、延缓支付赎回款项等情况，这将无法及时满足投资人的资产变现需求。巨额赎回为开放式基金特有的风险，在本基金发生巨额赎回时，基金管理人可能采用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、摆动定价等具体措施对赎回申请进行适度调整。当本基金发生巨额

赎回，且基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动等情形时，基金管理人可对部分赎回申请延期办理；当本基金遭遇大额申购赎回时，基金管理人可以通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响。上述流动性风险管理工具可能导致投资人的赎回申请无法得到及时确认、赎回款项无法得到及时支付、赎回价格因摆动定价机制存在更多的不确定性等情形。

### 3、收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

### 4、暂停基金估值

当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受申购赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

### 5、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

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值、实施侧袋机制等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并

以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 四、本基金特有的风险

##### 1、目标 ETF 的风险

本基金属于 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险（例如目标 ETF 的管理风险、操作风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险和技术风险等风险）可能直接或间接成为本基金的风险。

在本基金目标 ETF 未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。

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）投资对象和投资范围的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

（2）投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

（3）基金规模、投资成本、各种费用与税收的不同，会导致两只基金的业绩有差异。由于两只基金的投资对象和投资范围不同，投资管理方式不同，基金规模也可能不同，所以，本基金的投资成本、各种费用及税收可能不同于目标ETF；

（4）现金比例及现金管理方式的不同，会导致两只基金的业绩有差异。本基金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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的5%，而目标ETF则没有这项规定。

## 2、标的指数的风险

### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

### （2）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、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

### （3）标的指数变更的风险

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

## 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

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

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

（3）成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

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

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

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

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

#### 4、自动终止的风险

基金合同生效满3年之日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

目标ETF触发终止运作的情形，或目标ETF因退市变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，本基金将自动终止。

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，本基金将根据基金合同的约定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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止，但《基金合同》中“第十二部分 基金的投资”的“七、目标ETF发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。

故本基金存在基金合同自动终止的风险。

#### 5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在0.3%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

## 6、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 7、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，本基金将根据基金合同的约定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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止，但《基金合同》中“第十二部分 基金的投资”的“七、目标ETF发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。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。

## 五、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，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、目标 ETF 触发终止运作的情形，或目标 ETF 因退市变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，本基金将自动终止；
- 4、基金合同约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；



- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 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不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十部分 《基金合同》的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 发起资金提供方持有发起资金认购的基金份额不少于 3 年；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

(3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据基金合同及有关法律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人的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

(10) 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券、目标 ETF 所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报

告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基

金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- （25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （26）建立并保存基金份额持有人名册；
- （27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需的其他账户，为基金办理证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定外，不得利用

基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需的其他账户，按照基金合同、托管协议的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同、托管协议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，但因审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、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不低于法律法规规定的最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的基金登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

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份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使目标 ETF 的基金份额持有人大会的表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会；本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，由本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会不设日常机构。



（一）召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定外，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）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）调低销售服务费率，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

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

（5）本基金推出新业务或服务；

（6）基金管理人、销售机构、基金登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）增加新的基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售，或对基金份额分类办法及规则进行调整；

（8）标的指数更名或调整指数编制方法，或目标 ETF 更名；

（9）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30

日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持

有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召

集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### （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%（含 10%）以上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。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持

大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开

审议、逐项表决。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

### （七）计票

#### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

#### 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。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）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，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、目标 ETF 触发终止运作的情形，或目标 ETF 因退市变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，本基金将自动终止；
- 4、基金合同约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会

指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告

，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（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不低于法律法规规定的最低期限。

#### 四、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，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，仲裁费用由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不含台湾、香港、澳门地区）管辖并从其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同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章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备案并公告之日止。

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两份外，基金管理人、基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

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

## 第二十一部分 《托管协议》的内容摘要

### 一、托管协议当事人

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：刘军

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

基金托管人(或简称“托管人”)

名称：中信证券股份有限公司

注册地址：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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号

法定代表人：张佑君

成立时间：1995年10月25日

批准设立机关：国家工商总局

批准设立文号：100000000018305

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：1,211,690.84万人民币

经营范围：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公

司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

存续期间：无限期

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、衍生工具（股指期货、股票期权）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金成立以后还可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资。

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

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资比例进行监督。

（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：

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（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) 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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；

3) 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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%；

4) 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；

5) 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，有价证券指目标 ETF、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和目标 ETF 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%；

6) 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；

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) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

9) 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；

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该比例限制的，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；

12) 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 50%；

③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

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

13) 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%；

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。

因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第 1) 项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整；除上述第 1)、4)、10)、11)、12) 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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制或禁止行为，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。



4、基金托管人依据有关法律法規的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

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

5、本基金参与银行间市场交易，由基金管理人决定银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手；基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。基金托管人不对本基金参与银行间市场交易的交易对手和交易结算方式进行监控。

6、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。本基金的基金管理人根据相应规则确定存款银行，本基金投资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由相关责任人进行赔偿。基金托管人不对本基金投资银行存款的存款银行进行监控。

（二）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关监管规定。

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

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

券。

本基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

本基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

2. 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

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

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

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

基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

5. 基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

（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、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等（需管理人主动提供）进行监督和核查。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反法律法规、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日前及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。

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。基金管理人应赔偿因其违反法律法规、行业自律性规定或《基金合同》或本托管协议及其他有关规定而致使投资者和基金托管人遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反有关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反有关法律法规或者违反《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。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须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，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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 对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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，并予协助配合。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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

（三）基金管理人 发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，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、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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资金账户、证券账户等投资所需账户，相关开户费用由基金资产承担。

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、对于因为基金认申购、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。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

6、对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金财产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，若由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的原因给基金财产造成的损失等，基金托管人不承担责任。

7、除依据法律法规、《基金合同》及其他有关规定外，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、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的银行开立的“基金募集专户”，该账户由基金管理人开立并管理。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，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，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。同时，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为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

2、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供必要的协助。

## （三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴为“中信证券股份有限公司托管业务结算专用章”和基金托管人有权人名章。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，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，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银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他相关规定。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理

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未经另一方同意擅自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、基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以托管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。

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。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

《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；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

#### （六）其他账户的开立和管理

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

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

2、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

3、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。预留印鉴为“中信证券股份有限公司托管业务结算专用章”和基金托管人有权人名章。存款证实书原件由托管人负责保管。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。存款协议须约定将托管人为本产品开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

#### （八）基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于其档案库或保险柜，但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有，基金托管人承担保管职责。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （九）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当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。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后不低于法律法规规定的最低期限。

### 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

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类基金份额净值按照每个估值日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，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、复核程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日对基金资产估值后，将基金资产净值、各类基金份额净值



以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、股指期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2、估值方法

#### 1) 目标 ETF 基金份额的估值

本基金持有的目标 ETF 基金份额按估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。

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

②交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

④交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

⑤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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

⑥对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

②首次公开发行未上市的股票、债券，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在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

5) 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。

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

7) 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

8) 本基金参与转融通证券出借业务的，将按法律法规或参照行业协会的相关规定进行估值。

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

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

11) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，

按国家最新规定估值。

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

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

### （三）基金份额净值错误的处理方式

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

《基金合同》的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人及基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（4）由于本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致的，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（5）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

（6）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对仍不能达成一致时，为避免不能按时披露净值的情形，以基金管理人的计算结果对外披露，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（7）由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致净值计算错误造成基金委托人的损失，以及由此造成以后交易日净值计算顺延错误而引起的基金委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

## 5、特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按本协议约定的估值方法的第（9）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）由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算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。

### （四）暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

4、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和《基金合同》认定的其它情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《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。

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的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表和定期报告的编制和复核

##### 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；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两个月内予以公告；年度报告在会计年度终了后三个月内予以公告。《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。

##### 2、报表复核

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在 3 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 7 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 30 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 45 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加盖业务印鉴或者出具加盖业务印鉴的复核意见书，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证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

（八）基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金的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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 20 年，自基金账户销户之日起不得少于 20 年。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

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。

## （二）基金份额持有人名册的提交

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益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。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。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月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。

## 七、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。如经友好协商未能解决的，任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

（三）争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和《托管协议》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，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须报中国证监会备案。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

## （二）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、基金财产清算小组成员：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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。

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

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

### 4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

### 6、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。

7、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。

8、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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在固定报刊上。

9、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不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“基金份额持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。基金管理人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、基金管理人信息查询、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基金管理人客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

二、订制对账单服务

场内投资者每次交易结束后，可在 T+1 个工作日后到交易网点进行确认单的查询和打印，注册登记机构和基金管理人不会寄送场内投资者的对账单，投资者可随时到交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务手段查询。

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

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

2、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

3、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、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。

五、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十三部分 其他应披露事项

自 2022 年 6 月 1 日至 2023 年 5 月 31 日，本基金的临时公告刊登《中国证券报》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	关于新增平安银行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	2023-04-28
2	关于新增招商银行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	2023-04-07
3	关于增加上海陆享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	2023-03-01
4	关于增加博时财富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	2023-02-24
5	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023-02-15
6	关于增加上海中欧财富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	2023-02-07
7	建信基金管理有限责任公司关于增加泰信财富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	2022-10-11

投资者可通过《中国证券报》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。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

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

## 第二十五部分 备查文件

1、中国证监会准予建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件

2、《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

3、《建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

4、关于申请募集注册建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式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：投资人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

二〇二三年七月