

广发基金管理有限公司

广发中小板 300 交易型开放式指数证券  
投资基金联接基金招募说明书【更新】

[2014 年第 1 号]

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

时间：二〇一四年一月

### 【重要提示】

本基金于2011年3月21日经中国证监会证监基金字[2011]424号文核准。本基金基金合同于2011年6月9日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险。本基金为目标ETF的联接基金，通过投资目标ETF紧密跟踪中小板300价格指数的表现，与目标ETF存在如下差异：

（1）投资方法：目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股和备选成份股；而本基金通过主要投资于目标ETF，间接跟踪标的指数的业绩表现。

（2）发售方式：目标ETF分为网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式；本基金则是通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

（3）交易方式：目标ETF是交易型开放式指数基金，上市交易；本基金不上市交易。

（4）申购赎回：目标ETF采用份额申购和份额赎回的方式，通过指定场内券商办理基金的申购与赎回；本基金采用金额申购、份额赎回的方式，通过银行等场外销售机构办理基金的申购与赎回。

（5）价格揭示机制：目标ETF有实时市场交易价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。

（6）业绩表现：尽管跟踪同一标的指数，但二者业绩表现可能不同，引起业绩差异的因素主要包括：1）现金投资比例要求，目标ETF没有现金投资比例的要求，可以将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；2）申购赎回的影响，目标ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，不仅大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击，而且本基金为应对投资者以现金方式申赎而进行的证券交易需支付一定的手续费，该类费用将影响本基金相对于目标ETF的业绩表现。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年12月8日，有关财务数据和净值表现截止

日为2013年9月30日（财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分	绪言	1
第二部分	释义	2
第三部分	基金管理人	6
第四部分	基金托管人	12
第五部分	相关服务机构	18
第六部分	基金的募集	51
第七部分	基金合同的生效	46
第八部分	基金份额的申购、赎回与转换	46
第九部分	基金的投资	64
第十部分	基金的业绩	67
第十一部分	基金的财产	76
第十二部分	基金资产的估值	77
第十三部分	基金的收益与分配	84
第十四部分	基金费用与税收	86
第十五部分	基金的会计与审计	88
第十六部分	基金的信息披露	89
第十七部分	风险揭示	94
第十八部分	基金合同的变更、终止和基金财产的清算	97
第十九部分	基金合同的内容摘要	100
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	116
第二十一部分	对基金份额持有人的服务	132
第二十二部分	其他应披露事项	133
第二十三部分	招募说明书存放及查阅方式	138

第二十四部分 备查文件.....	138
------------------	-----

## 第一部分 绪言

《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）以及《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。基金合同是约定《基金合同》当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
- 2、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的的指数的 ETF（以下简称目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。简称联接基金
- 3、目标 ETF：指中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金（简称中小板 300ETF）
- 4、标的指数：指深圳证券交易所编制并发布的中小板 300 价格指数及其未来可能发生的变更
- 5、基金管理人或本基金管理人：指广发基金管理有限公司
- 6、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 7、招募说明书：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，及其定期的更新
- 8、基金合同或本基金合同：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 9、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 10、基金份额发售公告：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告》
- 11、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
- 12、《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，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 13、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
- 14、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券

投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订

15、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

16、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

19、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

20、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

21、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

22、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

23、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者

24、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的基金投资者

25、基金销售业务：指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

26、销售机构：指直销机构和代销机构

27、直销机构：指广发基金管理有限公司

28、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

29、基金销售网点：指直销机构及代销机构的代销网点

30、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

31、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为广发基金管理



有限公司或接受广发基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

32、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、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

33、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

34、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

35、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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

36、基金募集期限：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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、日：指公历日

40、月：指公历月

41、T 日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

43、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

45、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

46、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

47、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

48、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告，在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

49、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变更所持基金份额销售机构的操作

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

金申购申请的一种投资方式

51、巨额赎回：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)超过上一日基金总份额的 10%的情形

52、元：指人民币元

53、基金收益：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

54、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

55、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

56、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的数值

57、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

58、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

59、《业务规则》：指《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

60、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件。

## 第三部分 基金管理人

### 一、概况

1、名称：广发基金管理有限公司

2、住所：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-56 室

3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼

4、法定代表人：王志伟

5、成立时间：2003 年 8 月 5 日

6、电话：020-83936666

全国统一客服热线：95105828

7、联系人：段西军

8、注册资本：1.2 亿元人民币

9、股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司，分别持有本基金管理人 48.33%、16.67%、16.67%、10%和 8.33%的股权。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

王志伟：董事长，男，经济学硕士，高级经济师。兼任广东省第十届政协委员，广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员，广东金融学会常务理事，江西财经大学客座教授。历任广发证券董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长，广东发展银行行长助理，广东发展银行信托投资部总经理，广东发展银行人事教育部经理，广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉：副董事长，男，大学本科学历，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

孙晓燕：董事，女，硕士，现任广发证券副总裁、财务总监兼财务部总经理。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊：董事，男，管理学硕士，高级经济师，现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书，兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司等公司董事，兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿：董事，女，工商管理硕士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长，香江集团有限公司董事长兼总裁，深圳市金海马实业股份有限公司董事长，南方香江集团有限公司董事长，香江控股股份有限公司董事长。兼任广发证券监事，广发银行股份有限公司监事，全国妇联常委，中国产业发展促进会副会长，广东省政协常委，广东省工商联副主席，广东省妇联副主席，广东省女企业家协会会长，深圳市政协常委，香江社会救助基金会主席。

许冬瑾：董事，女，工商管理硕士，主管药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云：独立董事，男，法学博士，教授，博士生导师，现任复旦大学教授。曾任复旦大学法律系副主任，复旦大学法学院副院长。

姚海鑫：独立董事，男，经济学博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学发展规划处处长。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、辽宁大学工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、辽宁大学计财处处长、学科建设处处长。

罗海平：独立董事，男，经济学博士，现任阳光保险集团执行委员会委员，拟任阳光保险集团副总裁。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理，太平保险湖北分公司总经理，太平保险公司总经理助理，太平保险公司副总经理兼纪委书记，民安保险（中国）有限公司副总裁，阳光财产保险股份有限公司总裁。

## 2、监事会成员

余利平：监事会主席，女，经济学博士，兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军：监事，女，工商管理硕士，高级涉外秘书，现任广州科技风险投资有限公司工会主席、董事会秘书、办公室主任。曾任广州实达实业发展公司办公室主任、广州屈臣氏公司行政主管。

刘文红：监事，女，经济学硕士，现任广发基金管理有限公司电商及客服部副总经理。曾任广发证券研究发展中心研究员。

### 3、总经理及其他高级管理人员

林传辉：总经理，男，大学本科学历，兼任广发国际资产管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

肖雯：副总经理，女，企业管理硕士，高级经济师，兼任广发基金管理有限公司电商及客服部总经理。曾任珠海国际信托投资公司助理总经理、广发证券电子商务部副总经理、广发证券经纪业务总部副总经理。

朱平：副总经理，男，硕士，经济师，兼任广发基金管理有限公司量化投资部总经理，中国证券监督管理委员会第五届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方：副总经理，男，经济学硕士，经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发聚丰股票型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事、瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理，广发基金管理有限公司总经理助理。

陈伯军：副总经理，男，经济学博士，兼任瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券股份有限公司投行高级经理，广发基金管理有限公司筹备人员、中央交易室主管、上海分公司副总经理、市场拓展部总经理、市场总监、总经理助理。

邱春杨：副总经理，男，经济学博士，兼任广发基金管理有限公司金融工程部总经理，瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员，广发基金管理有限公司筹建人员、产品设计小组组长、机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、产品总监。

段西军：督察长，男，博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

### 4、基金经理

陆志明：男，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，14 年证券从业经历，1999 年 5 月至 2001 年 5 月任大鹏证券有限公司研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月就职于深圳证券信息有限公司，历任指数小组组长、指数部副总监、总监，2010 年 8 月至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300 联接基金的基金经理，2012 年 5 月 7 日起任广发深证 100 指数分级基金的基金经理。

魏军：男，中国籍，数量经济学博士，5 年基金从业经历，持有证券业执业资格证书，2008 年 7 月至 2010 年 10 月任广发基金管理有限公司量化研究员，2010 年 3 月 11 日起至 2011 年 10 月 18 日任广发沪深 300 指数基金和广发中证 500 指数基金的基金经理助理，2011 年 10 月 19 日起任广发中小板 300ETF 及广发中小板 300 联接基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

主席：公司总经理林传辉；成员：公司副总经理朱平，公司副总经理易阳方，投资总监、投资管理部总经理陈仕德，研究发展部总经理许雪梅，固定收益部总经理张芊。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### 四、基金管理人和基金经理的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (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谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、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、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责。

2、建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督的责任。

3、建立以监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。监察稽核部属于内核部门，直接接受总经理的领导，独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和监督。

4、建立以合规审核委员会及督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的第四道监控防线。



## 第四部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖

盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 二、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 三、基金托管业务经营情况

截止 2013 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 176 只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型

证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金 (LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基

金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲 (除日本) 机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金 (LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福

养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

##### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

#### 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管

理人进行提示：

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司、深圳理财中心、杭州理财中心及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务。

##### (1) 广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东3号东裙楼4楼

直销中心电话：020-89899073 020-89899042

传真：020-89899069 020-89899070

##### (2) 北京分公司

地址：北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层

电话：010-68083368

传真：010-68083078

##### (3) 上海分公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

##### (4) 深圳理财中心

地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦24楼05室

电话：0755-82701982

传真：0755-82572169

##### (5) 杭州理财中心

地址：杭州市西湖区华星路2-2号

电话：0571-81903158

传真：0571-81903158

##### (6) 网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

本公司网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

客服电话：95105828（免长途费）或020-83936999

客服传真：020-34281105

（7）投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

## 2、代销机构

（1）名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系人：赵会军

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客服电话：95588

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

（2）名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44

楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575或致电各地营业网点

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

（3）名称：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：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

客服电话：95533



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

(4) 名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

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

(5) 名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

传真：010-66594946

公司网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(6) 名称：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

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

(7) 名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

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

(8) 名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：詹全鑫、张大奕

电话：020-38322222、0571-96000888

传真：020-87311780

客服电话：400-830-8003

公司网站：www.cgbchina.com.cn

（9）名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（10）名称：上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路168号

法定代表人：宁黎明

联系人：张萍

电话：021-68475888

传真：021-68476111

客服电话：021-962888

公司网站：www.bankofshanghai.com

（11）名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-58560666

传真：010-57092611

客服电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

（12）名称：平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号

办公地址：深圳市深南中路1099号

法定代表人：孙建一

联系人：蔡宇洲

电话：0755-22197874 25879591

传真：0755-22197701

客服电话：40066-99999

公司网站：<http://bank.pingan.com>

（13）名称：北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：谢小华

电话：010-66223587

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

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

（14）名称：宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

联系方式：0574-89068340

传真：0574-87050024

客服电话：96528，上海、北京地区962528

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

(15) 名称：青岛银行股份有限公司

注册地址：山东省青岛市市南区香港中路68号

法定代表人：郭少泉

联系人：滕克

联系电话：0532-85709787

传真：0532-85709799

客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588

公司网站：www.qdccb.com

(16) 名称：徽商银行股份有限公司

住所：安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座

法定代表人：王晓昕

联系人：叶卓伟

电话：0551-2667635

传真：0551-2667684

客服电话：4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)

公司网站：www.hsbank.com.cn

(17) 名称：渤海银行股份有限公司

住所：天津市河西区马场道201-205号

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客户服务热线：4008888811

公司网站：www.cbhb.com.cn

(18) 名称：东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路193号

办公地址：东莞市运河东一路193号

法定代表人：廖玉林

联系人：巫渝峰

电话：0769-22100193

传真：0769-22117730

客服电话：40011-96228

公司网站：www.dongguanbank.cn

（19）名称：哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号

法定代表人：郭志文

联系人：王超

电话：0451-86779007

传真：0451-86779218

客服电话：95537

公司网站：www.hrbb.com.cn

（20）名称：东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人：何沛良

联系人：何茂才

电话：0769-22866255

传真：0769-22866282

客服电话：961122

公司网站：www.drcbank.com

（21）名称：浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

法定代表人：金子军

联系人：董晓岚 邵利兵

电话：0571-87117617 0571-87117616

传真：0571-87117616

(22) 名称: 北京农村商业银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街九号

办公地址: 北京市西城区金融大街9号金融街中心B座

法定代表人: 乔瑞

联系人: 王薇娜

联系电话: 010-63229475

传真: 010-63229763

客服电话: 010-96198

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

(23) 名称: 广州银行股份有限公司

注册地址: 广东省广州市越秀区广州大道北195号

法定代表人: 姚建军

客服电话: 400-83-96699 (全国), 020-96699 (广州)

联系人: 张扬眉

电话: 020-37598442

传真: 020-37590726

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

(24) 名称: 河北银行股份有限公司

注册地址: 石家庄市平安北大街28号

办公地址: 石家庄市平安北大街28号

法定代表人: 乔志强

联系人: 王栋

电话: 0311-88627522

传真: 0311-88627027

客服电话: 400-612-9999

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

(25) 名称: 江苏吴江农村商业银行股份有限公司

注册地址: 苏州市吴江区中山南路1777号

办公地址: 苏州市吴江区中山南路1777号

法人代表：陆玉根

联络人：王健

联系电话：0512-63969841

客服电话：4008696068、0512-96068

传真：0512-63969962

网址：www.wjrcb.com

（26）名称：广东顺德农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路2号

办公地址：广东省顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路2号

法定代表人：吴海恒

联系人：何浩华

电话：0757-22388928

传真：0757-22388235

客服电话：0757-22223388

网址：www.sdebank.com

（27）名称：大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼

办公地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼

法定代表人：陈占维

联系人：李鹏

电话：0411-82308602

传真：0411-82311420

客服电话：4006640099

公司网址：www.bankofd1.com

（28）名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵中路668号

办公地址：江苏省常州市延陵中路668号

法人代表：王国琛

联系人：续志刚

联系电话：0519-89995001

客服电话：0519-96005

传真：0519-89995001

网址：www.jnbank.cc

(29) 名称：包商银行股份有限公司

注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

办公地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

法人代表：李镇西

联络人：刘芳

联系电话：0472-5189051

客服电话：内蒙古地区：0472-96016

北京地区：010-96016

宁波地区：0574-967210

深圳地区：0755-967210

成都地区：028-65558555

传真：0472-5189057

网址：www.bsb.com.cn

(30) 名称：杭州银行股份有限公司

注册地址：中国. 杭州市庆春路46号

办公地址：中国. 杭州市庆春路46号

法人代表：吴太普

联系人：严峻

联系电话：0571-85108195

客服电话：4008888508

传真：0571-85106576

网址：www.hzbank.com.cn

(31) 名称：威海市商业银行股份有限公司

注册地址：威海市环翠区宝泉路9号

办公地址：威海市环翠区宝泉路9号



法定代表人：谭先国

联系电话：0631-5222293

业务传真：0631-5215726

客服热线：省内96636，境内40000-96636

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

(32) 名称：华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

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

客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

(33) 名称：申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址：上海市长乐路989号世纪商贸广场40层

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523或4008895523

电话委托：021-962505

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

(34) 名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666

公司网站：www.gtja.com

（35）名称：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：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。

公司网站：www.chinastock.com.cn

（36）名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：010-65182261

客服电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

（37）名称：天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

客服电话：010-66045678

传真：010-66045549

天相投顾网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(38) 名称：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

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

(39) 名称：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客服电话：95565、4008888111

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

(40) 名称：华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

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

(41) 名称：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：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000；400-6666-888

公司网站：www.cgws.com

（42）名称：东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

开放式基金咨询电话：4006000686；0431-85096733

开放式基金业务传真：0431-85096795

公司网站：www.nesc.cn

（43）名称：平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626319

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国免费业务咨询电话：95511—8

公司网站：www.pingan.com

（44）名称：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

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网站：www.bhzq.com

（45）名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务热线：95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：www.htsec.com

（46）名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

公司网站：www.dwzq.com.cn

（47）名称：金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

客服电话：4008-888-228

公司网站：www.jyzq.cn

(48) 名称: 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路1508号

办公地址: 上海市静安区新闻路1508号

法定代表人: 徐浩明

联系人: 刘晨

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客服电话: 4008888788, 10108998, 95525

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

(49) 名称: 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人: 朱科敏

客服电话: 95531; 4008888588

联系人: 梁旭

电话: 0519-88157761

传真: 0519-88157761

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

(50) 名称: 国盛证券有限责任公司

注册地址: 南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)

办公地址: 南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)

法定代表人: 曾小普

联系人: 陈明

电话: 0791-86281305

传真: 0791-86282293

客服电话: 4008-222-111

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

(51) 名称: 山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

客服电话：400-666-1618、95573

公司网站：www.i618.com.cn

（52）名称：国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街168号

办公地址：无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：95570

公司网站：www.glsc.com.cn

（53）名称：国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

公司地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客服电话：95563

公司网站：www.ghzq.com.cn

（54）名称：广州证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客服电话：020-961303

公司网站：www.gzs.com.cn

（55）名称：第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

电话：0755-25832852

传真：0755-25831718

客服电话：4008881888

公司网站：www.fcsc.cn

（56）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号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服电话：95558

公司网站：www.citics.com

（57）名称：德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人：姚文平

联系人：罗芳

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客服电话：400-8888-128



公司网站：www.tebon.com.cn

(58) 名称：国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

联系人：陈琳琳

联系电话：0551-2246273

开放式基金咨询电话：安徽地区：95578

开放式基金业务传真：0551-2272100

公司网站：www.gyzq.com.cn

(59) 名称：华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦

法定代表人：李工

联络人：甘霖

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

客服电话：96518（安徽），4008096518（全国）

公司网站：www.hazq.com

(60) 名称：中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

联系人：王霏霏

电话：0571-86078823

客服电话：95548

(61) 名称：中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：石保上

联系人：程月艳、耿铭

电话：0371-65585670

传真：0371-65585665

客服电话：0371-967218或4008139666

公司网站：www.ccnew.com

（62）名称：国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

客服电话：400-818-8118

公司网站：www.guodu.com

（63）名称：万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

联系人：罗创斌

联系电话：020-37865070

公司网站：www.wlzq.com.cn

（64）名称：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

公司网站：www.essence.com.cn

(65) 名称：中航证券有限公司

住所：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

公司网站：www.avicsec.com

(66) 名称：长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客服电话：955679或4008888999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服网站：www.95579.com

(67) 名称：瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15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12层、15层

法定代表人：程宜荪

联系人：牟冲

电话：010-58328112

传真：010-58328748

客服电话：400-887-8827

公司网站：www.ubssecurities.com

(68) 名称：宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客服电话：4008-000-562

公司网站：www.hysec.com

（69）名称：中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层  
01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

开放式基金咨询电话：400-600-8008

公司网站：www.china-invs.cn

（70）名称：齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：济南市经七路86号证券大厦

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

公司网站：www.qlzq.com.cn

（71）名称：方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

电话：0731-85832343

传真：0731-85832214

客服电话：95571

公司网站：www.foundersc.com

（72）名称：江海证券有限公司

地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客服电话：4006662288

公司网站：www.jhzq.com.cn

（73）名称：华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-50122086

传真：021-50122200

客服电话：4008209898

公司网站：www.cnhbstock.com

（74）名称：英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：吴尔晖

联系电话：0755-83007159

业务传真：0755-83007034

客服热线：4000-188-688

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

(75) 名称：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

联系电话：010-59355941

客服电话：40088-95618

公司网站：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(76) 名称：华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-4890100

传真：0931-4890118

客服电话：400-6898888

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

(77) 名称：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

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

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

(78) 名称：厦门证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：赵钦

电话：0592-5161642

传真：0592-5161640

客服电话：0592-5163588

公司网站：www.xmzq.cn

(79) 名称：南京证券有限责任公司

住所：江苏省南京市大钟亭8号

法定代表人：张华东

联系人：徐翔

电话：025-83367888-4201

传真：022-83320066

客户服务热线：4008285888

公司网站：www.njzq.com.cn

(80) 名称：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号A座三层、五层

法定代表人：宋德清

联系人：陶颖

电话：010-58568040

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

(81) 名称：浙商证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路1号

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层

法定代表人：吴承

联系人：谢项辉

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

客服电话：0571-967777

公司网站：www.stocke.com.cn

（82）名称：西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服电话：4008-096-096

公司网站：www.swsc.com.cn

（83）名称：红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

客服电话：400-871-8880

传真：0871-3578827

公司网站：www.hongtastock.com

（84）名称：国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘一宏

电话：028-86690070

传真：028-86690126



客服电话：4006600109

公司网站：www.gjzq.com.cn

（85）名称：联讯证券有限责任公司

注册地址：广东省惠州市下埔路14号

法定代表人：徐刚

客服电话：400-8888-929

联系人：丁宁

电话：010-64408820

传真：010-64408252

公司网站：www.lxzq.com.cn

（86）名称：新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：刘汝军

联络人：孙恺

联系电话：010-83561149

客服电话：400-698-9898

传真：010-83561094

网址：www.xsdzq.cn

（87）名称：日信证券有限责任公司

注册地址：呼和浩特市新城區錫林南路18号

办公地址：呼和浩特市新城區錫林南路18号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉

联系电话：010-88086830-730 010-88086830-737

传真：010-66412537

客服电话：010-88086830

公司网址：www.rxzq.com.cn

（88）名称：天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座

法人代表：余磊

联系人：翟璟

联系电话：027-87618882

客服电话 028-86712334

传真：027-87618863

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

(89) 名称：东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼

法人代表：张运勇

联系人：乔芳

联系电话：0769-22100155

客服电话：0769-961130

传真：0769-22119426

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

(90) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

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

(91) 名称：深圳众禄基金销售有限公司

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

办公地址：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

联系人：汤素娅

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

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

客服热线：4006-788-887

（92）名称：华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

办公地址：上海市肇嘉浜路750号

法定代表人：洪家新

联系人：陈敏

联系电话：021-64316642

业务传真：021-54653529

客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918

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

（93）名称：中山证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人：吴永良

联系人：刘军

联系电话：0755-82943755

业务传真：0755-82940511

客服热线：4001022011

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

（94）名称：中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

联系电话：010-65051166

业务传真：010-65051166

公司网址：www.cicc.com.cn

(95) 名称：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

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

业务传真：021-68596916

客服热线：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

(96) 名称：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

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

联系电话：0571-88911818-8565

业务传真：0571-86800423

客服热线：0571-88920897、4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(97) 名称：深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F（07）

办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F（07）

法定代表人：卓紘晶

联系人：王妮萍

联系电话：0755-33376853

业务传真：0755-33065516

客服热线：4006877899

公司网址：www.tenyuanfund.com

(98) 名称：中期时代基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

联系电话：010-65808756

业务传真：010-65807864

客服热线：95162、4008888160

公司网址：www.CIFCOFUND.com

(99) 公司名称：万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201

法定代表人：李招弟

联系人：高晓芳

联系电话：010-59393923

业务传真：010 -59393074

客服热线：400-808-0069

公司网址：www.wy-fund.com

(100) 名称：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

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系电话：021-54509998

业务传真：021-64385308

客服热线：4001818188

公司网址：www.1234567.com.cn

(101) 名称：杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

联系电话：021-60897840

业务传真：0571-26697013

客服热线：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## 二、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层

法定代表人：王志伟

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼

电话：020-89899170

传真：020-89899175

联系人：李尔华

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：国浩律师（广州）事务所

住所：广东省广州市体育西路 189 号城建大厦 9 楼

负责人：程秉

电话：020-38799345

传真：020-38799335

经办律师：程秉 黄贞

联系人：程秉

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法人代表：卢伯卿

联系人：黄晓霞

电话：021—61418888

传真：021—63350003

经办注册会计师：黄晓霞、余志亮

## 第六部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2011年3月21日经中国证监会证监基金字[2011]424号文核准募集。

### 一、基金运作方式

契约型开放式。

### 二、基金类型

股票型证券投资基金。

### 三、基金存续期限

不定期。

### 四、本基金与目标 ETF 的联系和区别

本基金是目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：

#### 1、二者的联系

(1) 两只基金均跟踪同一个标的指数即中小板 300 价格指数。

(2) 两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中小板 300 价格指数的表现，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、二者的区别

两只基金在投资方法、发售方式、交易方式、申购赎回、价格揭示机制和业绩表现等方面存在如下差异：

(1) 投资方法：目标 ETF 采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股和备选成份股；而本基金通过主要投资于目标 ETF，间接跟踪标的指数的业绩表现。

(2) 发售方式：目标 ETF 分为网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式；本基金则是通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

(3) 交易方式：目标 ETF 是交易型开放式指数基金，上市交易；本基金不上市交易。



(4) 申购赎回：目标 ETF 采用份额申购和份额赎回的方式，通过指定场内券商办理基金的申购与赎回；本基金采用金额申购、份额赎回的方式，通过银行等场外销售机构办理基金的申购与赎回。

(5) 价格揭示机制：目标 ETF 有实时市场交易价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。

(6) 业绩表现：尽管跟踪同一标的指数，但二者业绩表现可能不同，引起业绩差异的因素主要包括：1) 现金投资比例要求，目标ETF没有现金投资比例的要求，可以将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；2) 申购赎回的影响，目标ETF采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，不仅大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击，而且本基金为应对投资者以现金方式申赎而进行的证券交易需支付一定的手续费，该类费用将影响本基金相对于目标ETF的业绩表现。

## 五、募集方式与募集期限

本基金的募集方式为代销与直销。募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集对象为中国境内的个人投资者和机构投资者、合格境外机构投资者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者。

## 六、募集场所

本基金通过基金销售网点(包括基金管理人及代销机构的代销网点，具体名单见发售公告)公开发售。

## 七、基金份额发售面值、认购价格和认购费用

1、份额发售面值：人民币1.00元

2、认购价格：人民币1.00元

3、认购费用：

认购费用的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；

本基金对认购设置级差费率，认购费率随认购金额的增加而递减，最高认购费率不超过1.0%，投资者同一天可多笔认购，但适用费率按单笔分笔计算。具体费率如下：

| 认购金额 (M)           | 费率       |
|--------------------|----------|
| M < 100 万          | 1.00%    |
| 100 万 ≤ M < 500 万  | 0.60%    |
| 500 万 ≤ M < 1000 万 | 0.30%    |
| M ≥ 1000 万         | 1000 元/笔 |

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

#### 4、认购份额的计算

认购份额的计算方法如下：

- (1) 净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)；
- (2) 认购费用 = 认购金额 - 净认购金额；
- (3) 认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) / 基金份额发售面值。

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

例：某投资人投资10,000元认购本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为5元，则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.0\%) = 9,900.99 \text{元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{元}$$

$$\text{认购份额} = (9,900.99 + 5) / 1.00 = 9,905.99 \text{份}$$

即投资人投资10,000元认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到9905.99份基金份额。

## 八、投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排、认购者认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

### 2、认购方式

本基金认购采取全额缴款认购的方式。

(1) 基金投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

(2) 基金投资者在募集期内可多次认购，认购一旦被注册登记机构确认，就不再接受撤销申请。

### 3、认购确认

基金发售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。投资者可在基金正式宣告成立后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

### 4、认购限制

(1) 基金投资者在募集期内可多次认购，认购一旦被注册登记机构确认，就不再接受撤销申请。

(2) 在募集期内，每一基金投资者在代销机构销售网点首次认购的最低额为人民币 1,000 元（含认购费），追加认购金额为 1,000 元（含认购费）；每一基金投资者在直销机构销售网点（非网上交易系统）认购的最低额为人民币 50,000 元（含认购费），已在基金管理人销售网点有认购本基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制，但受追加认购最低金额的限制。

## 九、首次募集期间认购资金利息的处理方式

本基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期间形成的利息折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准。

## 第七部分 基金合同的生效

### （一）、基金合同生效

本基金基金合同已于 2011 年 6 月 9 日正式生效。

### （二）、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过基金管理人及代销机构的代销网点进行。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以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的申购与赎回。

- 1、本公司直销机构；
  - 2、代销机构：经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。
- （详见本招募说明书第五部分）

### 二、申购与赎回的开放日及时间

本基金基金合同已于 2011 年 6 月 9 日正式生效，本基金自 2011 年 8 月 22 日起开始办理日常申购、赎回、转换、定期定额投资等业务。

基金投资者在开放日申请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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

### 三、申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即基金份额的申购与赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，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、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

### 四、申购与赎回的数额限制

- 1、通过代销机构每个基金账户首次最低申购金额为 1,000 元(含申购费)人民币；投资人追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各代销机构网点公告。
- 2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元（含申购费）人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受申购最低金额的限制。
- 3、基金份额持有人赎回本基金的最低份额为 100 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致该基金份额持有人在一個网点的基金份额余额少于相应的最低赎回限额时，余额部分的基金份额必须一同赎回。
- 4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 五、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请

基金投资者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。

基金投资者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，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

## 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者可在 T+2 日后（包括该日）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。

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、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

# 六、申购费率、赎回费率

## 1、申购费率

(1) 本基金对申购设置级差费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

| 申购金额 (M)           | 费率       |
|--------------------|----------|
| M < 100 万          | 1.20%    |
| 100 万 ≤ M < 500 万  | 0.80%    |
| 500 万 ≤ M < 1000 万 | 0.40%    |
| M ≥ 1000 万         | 1000 元/笔 |

(2) 本基金的申购费用由申购基金份额的投资者承担，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。

(3) 基金管理人对部分基金持有人费用的减免不构成对其他投资者的同等义务。

## 2、赎回费率

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减，具体费率如下：

| 赎回期限 (N)    | 赎回费率  |
|-------------|-------|
| N < 一年      | 0.50% |
| 一年 ≤ N < 两年 | 0.30% |
| N ≥ 两年      | 0%    |

3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体上公告。

4、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），在不违背法律法规规定的情况下，基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、本基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0510 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.2%) = 9,881.42 元

申购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 元

申购份额=9,881.42/1.0510=9,401.92 份

即：投资者投资 10,000 元申购本基金，对应申购费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.0510 元，则可得到 9,401.92 份基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算：

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

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回 10 万份基金份额，份额持有期限 100 天，对应赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 =100,000×1.2130=121,300.00 元

赎回费用 =121,300.00×0.5% = 606.50 元

净赎回金额 =121,300.00-606.50=120,693.50 元

即：投资者赎回本基金 10 万份基金份额，份额持有期限 100 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的净赎回金额为 120,693.50 元。

## 3、本基金基金份额净值的计算：

T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回



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

## 八、申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；
- 2、证券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；
- 3、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形；
- 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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- 7、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者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、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 4、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 6、目标 ETF 暂停赎回，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形；
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，若出现上述第 3 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 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顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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日基金总份额的 10%的前提下，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；基金投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

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

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并依照有关规定在指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

## 十三、基金的转换

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

#### 十四、基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

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注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### 十五、基金的转托管

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

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

#### 十六、定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公告为准。

#### 十七、其他情形

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、转出申请、非交易过户以及基金的转托管。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

通过将绝大部分基金资产投资于中小板 300ETF，紧密跟踪标的指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 二、投资理念

中国经济和资本市场的长期发展，推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念，以中小板 300 ETF 为主要投资对象，为投资者获取与中小板 300 价格指数相近的回报。

### 三、投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300ETF、中小板 300 价格指数成份股和备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

### 四、投资策略

本基金为中小板 300ETF 联接基金。中小板 300ETF 是采用完全复制的方法实现对中小板 300 价格指数紧密跟踪的被动式指数基金，本基金主要通过投资于中小板 300ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

当本基金申购赎回中小板 300ETF 基金份额和在二级市场买卖中小板 300ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时、或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。

### （一）资产配置策略

本基金主要投资于中小板 300ETF、中小板 300 价格指数成份股和备选成份股，其中投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

### （二）目标 ETF 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中小板 300ETF，使本基金投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。

#### 2、投资组合的投资方式

本基金投资于中小板 300ETF 的两种方式如下：

（1）申购和赎回：中小板 300ETF 开放申购赎回后，通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。

（2）二级市场方式：中小板 300ETF 上市交易后，通过券商在二级市场进行中小板 300ETF 基金份额的交易。

在基金的日常投资管理中，本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标 ETF 的基金份额，实现指数化投资目标。同时，本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。例如，在买入、卖出量低于最小申购、赎回单位时，基金管理人可以通过二级市场直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。这两种投资方式的选择，首先要考虑交易便利性及市场流动性两个方面的因素；其次，在交易制度允许和市场流动性充分的前提下，通过综合考虑交易成本和价格优势，优化得出目标基金 ETF 份额的买入、卖出数量。

当中小板 300ETF 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。

#### 3、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资中小板 300ETF 的时间和方式。

(1) 当净申购时, 本基金将根据净申购规模及仓位情况, 决定股票组合的构建、中小板 300ETF 的申购或买入等;

(2) 当净赎回时, 本基金将根据净赎回规模及仓位情况, 决定中小板 300ETF 的赎回或卖出等。

### (三) 股票投资策略

#### 1、股票组合构建原则

根据标的指数, 结合研究报告和基金组合的构建情况, 采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

#### 2、股票组合构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小板指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法, 根据中小板 300 价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制, 基金管理人可以根据市场情况, 结合经验判断, 对股票组合管理进行适当变通和调整, 以更紧密的跟踪标的指数。

#### 3、股票组合的调整

##### (1) 定期调整

本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小板 300 价格指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

##### (2) 不定期调整

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

针对我国证券市场新股发行制度的特点, 本基金将参与一级市场新股认购, 由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

### (四) 债券投资策略

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

## 五、投资决策依据和决策程序

### (一) 投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策

依据。

## （二）投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策，特别是对目标 ETF 份额的投资决策。

## （三）投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究：数量投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标 ETF 二级市场的流动性和折溢价分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

2、投资决策：投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

3、组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理构建以目标 ETF 为主的投资组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

4、交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5、绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整：基金经理将跟踪目标 ETF 及标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。



## 六、标的指数和业绩比较基准

本基金标的指数为中小板 300 价格指数。

本基金业绩比较基准为：中小板 300 价格指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，或者目标 ETF 标的指数发生变更时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。

## 七、风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金，风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于中小板 300ETF，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 八、投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金参与股票发行申购，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；
- (2) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (3) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；
- (4) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；
- (5) 本基金投资于目标ETF 的比例不低于基金资产净值的90%；
- (6) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易

停牌等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 九、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 十、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 十一、基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## 十二、基金投资的变更

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金《基金合同》中将去掉关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、目标 ETF 交易方式变更；
- 2、目标 ETF 终止上市；
- 3、目标 ETF 基金合同终止。

## 十三、基金投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据本基金基金合同规定，于 2014 年 1 月 6 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 2013 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况（适用于 ETF 联接基金填写）

| 序号 | 项目     | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 1,081,955.00   | 0.21         |
|    | 其中：股票  | 1,081,955.00   | 0.21         |
| 2  | 基金投资   | 480,600,303.10 | 94.32        |
| 3  | 固定收益投资 | -              | -            |
|    | 其中：债券  | -              | -            |
|    | 资产支持证券 | -              | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 4 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 24,619,537.12  | 4.83   |
| 7 | 其他各项资产            | 3,218,182.76   | 0.63   |
| 8 | 合计                | 509,519,977.98 | 100.00 |

2、期末投资目标基金明细（适用于 ETF 联接基金填写）

| 序号 | 基金名称                 | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|------|--------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 广发中小板300交易型开放式证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式 | 广发基金管理有限公司 | 480,600,303.10 | 94.79        |

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 87,570.00  | 0.02         |
| C  | 制造业              | 539,061.00 | 0.11         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | 14,952.00  | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | -          | -            |

|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,592.00     | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业          | 13,600.00    | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 214,540.00   | 0.04 |
| J | 金融业             | -            | -    |
| K | 房地产业            | 3,532.00     | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业        | 198,700.00   | 0.04 |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 7,408.00     | 0.00 |
| 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              | 1,081,955.00 | 0.21 |

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 002400 | 省广股份 | 4,000  | 175,600.00 | 0.03         |
| 2  | 002065 | 东华软件 | 4,000  | 131,520.00 | 0.03         |
| 3  | 002292 | 奥飞动漫 | 3,300  | 121,242.00 | 0.02         |
| 4  | 002240 | 威华股份 | 20,500 | 97,785.00  | 0.02         |
| 5  | 002155 | 辰州矿业 | 9,000  | 87,570.00  | 0.02         |
| 6  | 002004 | 华邦颖泰 | 4,500  | 79,650.00  | 0.02         |
| 7  | 002268 | 卫士通  | 3,000  | 56,220.00  | 0.01         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 8  | 002211 | 宏达新材 | 7,700 | 43,274.00 | 0.01 |
| 9  | 002129 | 中环股份 | 1,200 | 29,820.00 | 0.01 |
| 10 | 002171 | 精诚铜业 | 4,200 | 26,838.00 | 0.01 |

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细本

基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、投资组合报告附注

(1)根据公开市场信息,报告期本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2)报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 151,256.65   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,877,208.00 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,757.84     |
| 5  | 应收申购款   | 1,184,960.27 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,218,182.76 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 002400 | 省广股份 | 175,600.00     | 0.03         | 重大事项     |
| 2  | 002065 | 东华软件 | 131,520.00     | 0.03         | 重大事项     |
| 3  | 002292 | 奥飞动漫 | 121,242.00     | 0.02         | 重大事项     |
| 4  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 5  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 6  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 7  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 8  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 9  | -      | -    | -              | -            | -        |
| 10 | -      | -    | -              | -            | -        |

第十部分 基金业绩

本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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2013 年 9 月 30 日。

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长率标 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------------|--------|------------|------|-----|-----|
|----|------------|--------|------------|------|-----|-----|

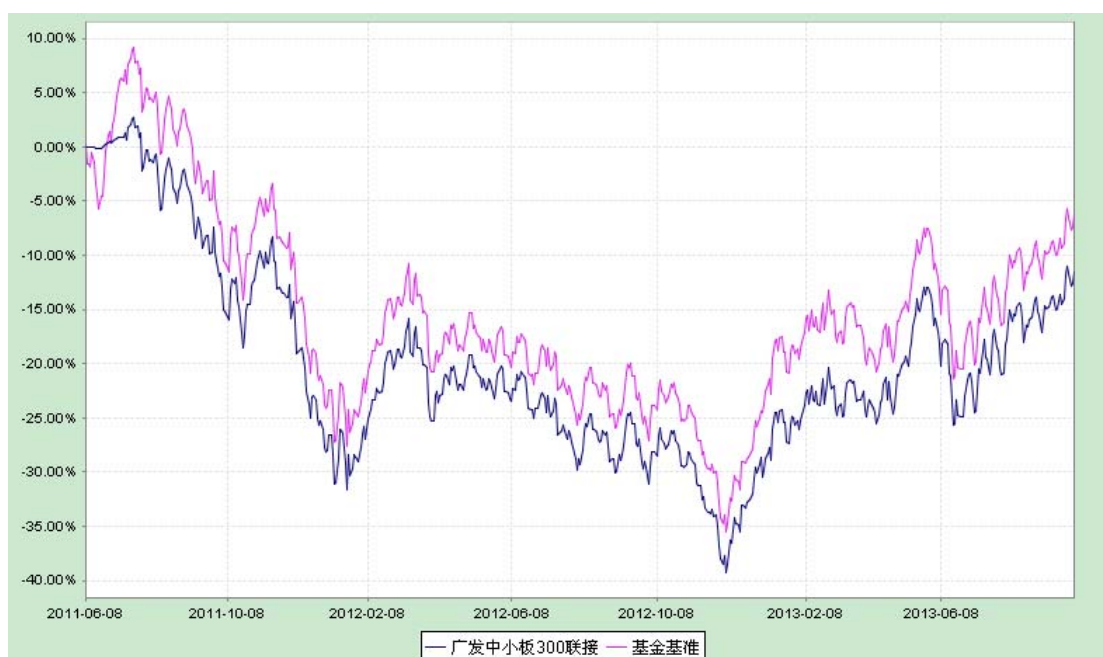
|                       |         | 准差②   |         | 基准<br>收益<br>率标<br>准差<br>④ |        |        |
|-----------------------|---------|-------|---------|---------------------------|--------|--------|
| 2013.01.01-2013.09.30 | 24.01%  | 1.48% | 24.40%  | 1.49%                     | -0.39% | -0.01% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | -2.85%  | 1.42% | -2.57%  | 1.44%                     | -0.28% | -0.02% |
| 2011.06.09-2011.12.31 | -26.56% | 1.29% | -22.40% | 1.42%                     | -4.16% | -0.13% |
| 自基金合同生效至今             | -11.52% | 1.41% | -6.27%  | 1.45%                     | -5.25% | 0.04%  |

## 二、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 6 月 9 日至 2013 年 9 月 30 日)





## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的包括目标 ETF 份额在内的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以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金额。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人、基金代销机构以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人、基金代销机构因依法解散、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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常交易日，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。

### 三、估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证及其他基金资产。

### 四、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以双方认可的形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、估值方法

#### 1、目标 ETF 估值方法：

目标 ETF 按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。

#### 2、股票估值方法：

##### （1）上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整

最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、债券估值方法：

(1) 在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）-（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）-（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 4、权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）-（3）项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）-（3）项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

### 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

## 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

## 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

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

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

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 4 位以内 (含第 4 位) 发生差错时, 视为基金份额净值错误; 基金份额净值出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 通报基金托管人, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大; 当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时, 基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会; 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; 当发生净值计算错误时, 由基金管理人负责处理, 由此给基金份额持有人和基金造成损失的, 应由基金管理人先行赔付, 基金管理人按差错情形, 有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时, 基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任, 经确认后按以下条款进行赔偿:

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 与本基金有关的会计问题, 如经双方在平等基础上充分讨论后, 尚不能达成一致时, 按基金会计责任方的建议执行, 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;

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告, 而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明, 份额净值出错且造成基金份额持有人损失的, 应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金, 就实际向投资者或基金支付的赔

偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事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、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、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；
- 3、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；
- 5、如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

## 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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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



## 第十三部分 基金的收益与分配

### 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

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 3、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、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式，在同一销售机构只能选择一种收益分配方式，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、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

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## **六、基金收益分配中发生的费用**

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

## 第十四部分 基金费用与税收

### 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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金财产划拨支付的银行费用；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

### 三、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

在通常情况下，本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、上述一中 3 到 7 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### **四、不列入基金费用的项目**

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

#### **五、费用调整**

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

#### **六、基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日，如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒体上公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### 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、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，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在承诺公开披露的基金信息时，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、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、招募说明书、基金合同、托管协议

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

(1) 招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

(3) 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。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

## 4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

## 5、基金资产净值、基金份额净值公告

本基金合同生效后，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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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

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

## 6、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上。

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

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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

#### 8、临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管



部门负责人发生变动；

(9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

(10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；

(11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

(12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

(14) 重大关联交易事项；

(15) 基金收益分配事项；

(16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

(18) 基金改聘会计师事务所；

(19) 基金变更、增加或减少销售机构；

(20) 基金更换注册登记机构；

(21) 本基金开始办理申购、赎回；

(22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；

(24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

(25) 本基金暂停接受申购、赎回申请；

(26) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；

(27) 基金推出新业务或服务；

(28) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

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

## 10、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核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时

间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

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

11、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，指定专人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的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

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

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

(2) 经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

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

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

#### 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

(1) 决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

(2) 操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

(3) 技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

#### 4、流动性风险

基金的流动性风险主要表现在三个方面：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于市场流动性相对不足而无法按预期的价格将目标 ETF、股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金管理人的现金支付出现困难，被迫在不适当的价格大量抛售目标 ETF、股票或债券；三是目标 ETF 暂停赎回或暂停在二级市场交易，导致基金管理人出现现金支付困难，基金管理人因此暂停接受投资者的赎回申请。以上情形均可能给本基金带来不利影响。

#### 5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 6、本基金特有的风险

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

##### （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中的证券交易成本、基金管理费和托管费的存在以及其它因素，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

##### （4）投资于目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金，主要投资对象是目标 ETF，因此目标 ETF 面临的诸如管理风险与操作风险、目标 ETF 份额二级市场交易价格折溢价的风险等，可能直接或间接成为本基金的风险。

（5）本基金为目标 ETF 的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生差异的原因主要包括：1）现金投资比例要求，目标 ETF 没有现金投资比例的要求，可以将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；2）申购赎回的影响，目标 ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金

申赎采取现金方式，不仅大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击，而且本基金为应对投资者以现金方式申赎而进行的证券交易需支付一定的手续费，该类费用将影响本基金相对于目标 ETF 的业绩表现。

## 7、其他风险

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

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

(3) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

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

(7) 其他意外导致的风险。

## 二、声明

1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金管理人指定的基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1、按照法律法规或本基金合同的规定，下列涉及到基金合同变更的事项应当召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效：

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(4) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(4) 因为基金管理人、基金托管人名称、住所、法定代表人变更，基金管理人、基金托管人分立、合并等原因导致基金合同内容必须做出相应变动的；

(5) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(6) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；

(7) 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；

(8) 按照法律法规或本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、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 三、基金财产的清算

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

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

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

### 4、基金财产清算程序

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

## 四、清算费用

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

## 五、基金财产的清偿、分配顺序

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。

## 六、基金财产清算的公告

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

## 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 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

基金投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 出席或者委派代表出席目标 ETF 份额持有人大会，对目标 ETF 份额持有人大会审议事项行使表决权；

(7) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(8) 监督基金管理人的投资运作；

(9) 对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(10) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

(2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (3) 依据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (4) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
- (6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- (8) 根据本基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- (9) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(12) 依法召集基金份额持有人大会；

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

(14) 经与基金托管人协商一致，代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利；

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

(16) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(17) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

(5) 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财产分别管理，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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 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；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

(15) 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；

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

(17) 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；

(18) 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；

(19) 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；

(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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 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；

(27) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

(1) 获得基金托管费；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

(6) 依法提议召开或召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

(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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

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

(9) 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少于 15 年；

(10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 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；

(24) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

(四) 本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

### (二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上（“以上”含本数，下同）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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止

上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(5) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10) 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 份额持有人大会；

(11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(4) 因为基金管理人、基金托管人名称、住所、法定代表人变更，基金管理人、基金托管人分立、合并等原因导致基金合同内容必须做出相应变动的；

(5) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(6) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(7) 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；

(8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

#### (四) 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、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 日在指定媒体网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 会议形式；

(4) 议事程序；

(5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

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

(7) 表决方式；

(8) 会务常设联系人姓名、电话；

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并



在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

##### 2、召开基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

###### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，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代表的基金

份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

4) 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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

#### (六) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

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

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

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

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并

保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经公证后形成大会决议。

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

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

### (2) 通讯方式开会

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

## 3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)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

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

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

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

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、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。

#### (八) 计票

##### 1、现场开会

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

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

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

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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

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

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体公告。

4、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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十) 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。

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 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 份额持有人大会的，由本基金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 份额持有人大会。

(十一) 法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

#### (一) 基金合同的变更

1、按照法律法规或本基金合同的规定，下列涉及到基金合同变更的事项应当召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效：

(1) 转换基金运作方式；

(2) 变更基金类别；

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

(4) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；

(4) 因为基金管理人、基金托管人名称、住所、法定代表人变更，基金管理人、基金托管人分立、合并等原因导致基金合同内容必须做出相应变动的；

(5) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(6) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；

(7) 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；

(8) 按照法律法规或本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) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；

3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

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

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

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

#### 2、基金财产清算程序

(1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2) 对基金财产进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估价和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将基金清算结果报告中国证监会；

(8) 公布基金清算报告；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3、清算费用

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

#### 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组

公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议解决方式

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。



## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

邮政编码：510308

法定代表人：王志伟

成立日期：2003 年 8 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]91 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.2 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外

国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300ETF、中小板 300 价格指数成份股和备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1、本基金参与股票发行申购，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；

2、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

3、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

4、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

5、本基金投资于目标ETF 的比例不低于基金资产净值的90%；

6、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应

按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

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

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

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

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

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

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

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

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变

化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

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

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

（八）基金管理人应义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（九）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对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, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为, 包括但不限于: 提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性, 在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

### 四、基金财产保管

#### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令, 基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理, 确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令, 按照基金合同和本协议的约定保管基金财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金认(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财产账户的, 基金托管人应

及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

#### （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进

行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

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

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对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。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。



## 五、基金资产净值计算与复核

### （一）基金资产净值的计算及复核程序

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

#### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1、估值对象

基金依法拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证及其他基金资产和负债。

#### 2、估值方法

##### （1）目标 ETF 估值方法：

目标 ETF 按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。

##### （2）股票估值方法：

##### 1) 上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

##### 2) 未上市股票的估值。

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规

定确定公允价值。

3) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) —2) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) —2) 小项规定的方法对基金资产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, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值;

4) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(3) 债券估值方法:

1) 在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如果估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值; 如果估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

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

4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本进行后续计量。

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

6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

7) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) —6) 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) —6) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

8) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(4) 权证估值方法:

1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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。

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 3) 项、债券估值方法的第 7) 项、权证估值方法的第 4) 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.50% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，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。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 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。如果行业有通行做法，双方当事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。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 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；

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

(4) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；

(5) 如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(6) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### （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

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；半年度报告在会计年度上半年终了后 60 日内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并予以公告。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、半年度报告或者年度报告。

#### 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 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 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。基金管理人在半年度报告完成当日，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 30 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 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加密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托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，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中国证监会备案。

（八）基金托管人在对财务会计报告、半年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，以备有关机构对相关文件审核时提示。

（九）基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

（十）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登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 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。

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

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、

尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止的情形

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

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

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

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

(3) 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本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

#### 2、基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 编制清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；

(8) 公布基金清算报告；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的公告

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

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

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

### 一、持有人注册登记服务

基金管理人担任基金注册登记机构，为基金份额持有人提供注册登记服务，配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、基金份额的登记、权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发、基金交易份额的清算过户等服务。

### 二、持有人交易记录查询及邮寄服务

#### 1、基金交易确认服务

注册登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金投资记录。基金份额持有人每次交易结束后（T 日），本基金销售网点将于 T+2 日开始为基金份额持有人提供该笔交易成交确认单的查询服务。基金份额持有人也可以在 T+2 日通过本基金管理人客户服务中心查询基金交易情况。基金管理人直销机构网点应根据在直销机构网点进行交易的基金份额持有人的要求打印成交确认单。基金销售代理人应根据在代销网点进行交易的基金份额持有人的要求进行成交确认。

#### 2、对账单服务

基金份额持有人可通过以下方式查阅对账单：

1) 基金份额持有人可登陆本基金管理人的网站账户自动查询系统查阅对账单。

2) 基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制纸质或电子形式的定期对账单。定期对账单分为季度对账单及年度对账单。本基金管理人在每季度结束后向本季度有交易并定制季度对账单服务的投资者提供季度对账单；每年结束后向所有本年度末持有基金份额并定制年度对账单服务的投资者提供年度对账单。

#### 3、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心(包括电话呼叫中心和网站账户自动查询系统)和本基金管理人的销售网点查询历史交易记录。

### 三、信息定制服务

基金份额持有人在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址，可订制电子邮件服务，内容包括基金净值播报、交易确认及相关基金资讯信息等；如预留手机号码，可订制手机短信服务，内容包括基金净值播报、交易确认等。已开立本公司基金账户未预留相关资料的基金份额持有人可到销售网点或通过基金管理人的客户服务中心（包括电话呼叫中心和网站账户自动查询系统）办理资料变更。

#### 四、信息查询

基金管理人为每个基金账户提供一个基金账户查询密码，基金份额持有人可以凭基金账号和该密码通过基金管理人的电话呼叫中心（Call Center）查询客户基金账户信息；同时可以修改通信地址、电话、电子邮件等信息；另外还可登录本基金管理人网站查询基金申购与赎回的交易情况、账户余额、基金产品信息。

#### 五、投诉受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网站在线客服、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和代销机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话进行投诉。

#### 六、服务联系方式

##### 1、客户服务中心

电话呼叫中心（Call Center）：95105828 或 020-83936999，该电话可转人工服务。

传真：020-34281105

##### 2、互联网网站

公司网址：<http://www.gffunds.com.cn>

电子信箱：[services@gf-funds.com.cn](mailto:services@gf-funds.com.cn)

### 第二十二部分 其他应披露事项

1、本基金管理人于 2013 年 7 月 9 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 7 月 9 日起通过威海市商业银行代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股

票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金和广发新经济股票型发起式证券投资基金。

2、本基金管理人于 2013 年 7 月 11 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 7 月 11 日起通过好买基金代理销售以下基金：广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金。3、本基金管理人于 2013 年 7 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 7 月 19 日起通过同花顺基金代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金和广发美国房地产指数证券投资基金。

4、本基金管理人于 2013 年 7 月 29 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 7 月 29 日起通过中山证券代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型

证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金(人民币份额)、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)和广发深证 100 指数分级证券投资基金。

5、本基金管理人于 2013 年 8 月 28 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,本公司决定自 2013 年 8 月 28 日起调整旗下以下基金转换起点份额和最低持有份额:广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金(人民币份额)、广发美国房地产指数证券投资基金(美元份额)、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)和广发深证 100 指数分级证券投资基金。

6、本基金管理人于 2013 年 9 月 2 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告,决定自 2013 年 9 月 2 日起公司旗下以下基金参加河北银行电子渠道申购及定期定额投资申购费率优惠活动:广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚

瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金和广发轮动配置股票型证券投资基金。

7、本基金管理人于 2013 年 9 月 25 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 9 月 25 日起通过深圳腾元基金代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金和广发美国房地产指数证券投资基金（人民币份额）。

8、本基金管理人于 2013 年 10 月 9 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 10 月 9 日起通过杭州数米基金代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、

广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金（人民币份额）、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发中债金融债指数证券投资基金。

9、本基金管理人于 2013 年 10 月 18 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 10 月 18 日起通过中期时代基金销售（北京）有限公司代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金（人民币份额）、广发中债金融债指数证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金和广发亚太中高收益债券型证券投资基金（人民币份额）。

10、本基金管理人于 2013 年 10 月 18 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，本公司决定自 2013 年 10 月 18 日起通过万银财富（北京）基金销售有限公司代理销售以下基金：广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农

业指数证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金（人民币份额）、广发中债金融债指数证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金和广发亚太中高收益债券型证券投资基金（人民币份额）。

### 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

### 第二十四部分 备查文件

（一）中国证监会批准广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

（二）《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照