

**MSCI 中国 A 股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）**

2015 年第 1 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会2014年8月19日证监许可[2014]870号文注册募集。本基金基金合同于2015年2月12日正式生效。

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

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，本基金的特定风险等。本基金为 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称 MSCI 中国 A 股 ETF）的联接基金，主要通过投资 MSCI 中国 A 股 ETF 紧密跟踪标的指数的表现，因此本基金的净值会因 MSCI 中国 A 股 ETF 净值波动而产生波动。本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2015年8月12日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年6月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	4
四、基金托管人.....	12
五、相关服务机构.....	14
六、基金的募集.....	34
七、基金合同的生效.....	34
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	34
九、基金的投资.....	59
十、基金的业绩.....	67
十一、基金的财产.....	68
十二、基金资产的估值.....	68
十三、基金的收益与分配.....	72
十四、基金的费用与税收.....	73
十五、基金的会计与审计.....	75
十六、基金的信息披露.....	76
十七、风险揭示.....	80
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	84
十九、基金合同的内容摘要.....	85
二十、基金托管协议的内容摘要.....	99
二十一、对基金份额持有人的服务.....	106
二十二、其他应披露事项.....	108
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	109
二十四、备查文件.....	109

一、绪言

《MSCI 中国 A 股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）》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定以及《MSCI 中国 A 股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、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、目标 ETF：另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（简称 ETF），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且，该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金以 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF。

3、ETF 联接基金：是指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金。

4、基金管理人：指华夏基金管理有限公司。

- 5、基金托管人：指中国银行股份有限公司。
- 6、基金合同、《基金合同》：指《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充。
- 7、托管协议：指基金管理人及基金托管人就本基金签订之《MSCI 中国 A 股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。
- 8、招募说明书：指《MSCI 中国 A 股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。
- 9、基金份额发售公告：指《MSCI 中国 A 股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》。
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等。
- 11、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 12、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 13、《信息披露办法》：指《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 14、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。
- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会。
- 17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。
- 18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人。
- 19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。
- 20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者。
- 21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称。
- 22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人。
- 23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金

份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

24、销售机构：指华夏基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构。

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为华夏基金管理有限公司或接受华夏基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。

27、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、由该登记机构办理登记的基金份额余额及其变动情况的账户。

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户。

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

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

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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限。

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。

35、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日。

36、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)。

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段。

38、《业务规则》：指《华夏基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守。

39、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为。

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

份额的行为。

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为。

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

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

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

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

46、元：指人民币元。

47、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

48、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。

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

50、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。

51、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。

52、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站或其他媒介。

53、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：张静

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
山东省农村经济开发投资公司	10%
POWER CORPORATION OF CANADA	10%
青岛海鹏科技投资有限公司	10%
南方工业资产管理有限责任公司	7.8%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，中信证券股份有限公司党委委员，硕士，高级经济师。兼任华夏资本管理有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。

徐刚先生：董事，博士，经济师。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、经纪业务发展与管理委员会主任委员、研究部行政负责人，兼任中信证券（山东）、中信期货、前海股权交易中心、青岛蓝海股权交易中心、厦门两岸股权交易中心等公司董事。曾任中国地质机械仪器工业总公司干部，曾任职于中信证券股份有限公司研究咨询部、资产

管理部、金融产品开发小组、金融组、研究部、股票销售交易部，担任经理、高级经理、部门副总经理、部门总经理、部门行政负责人等职务。

葛小波先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、董事总经理、计划财务部行政负责人，兼任华夏资本管理有限公司董事。曾任中信证券股份有限公司投资银行部高级经理、上市部副主任、风险控制部执行总经理、交易部（现交易与衍生产品业务部）行政负责人。

汤晓东先生：董事、总经理，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建设（香港上市）、华夏幸福基业、中海油海洋工程、荣信股份、东兴证券等五家上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任同方环境股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事会理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李一梅女士：副总经理，硕士。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监等。

周璇女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理；曾任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东渤海轮渡股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员，济青高速公路管理局经营财务处副主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部经理，山东高速股份有限公司董事、党委委员、总会计师。

汪贵华女士：监事，博士。现任华夏基金管理有限公司董事总经理。曾任财政部科研所助理研究员、中关村证券股份有限公司计划资金部总经理、华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司法律监察部总监。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁、华夏基金管理有限公司法律监察部副总经理等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师。

2、本基金基金经理

张弘弢先生，硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理等，现任数量投资部执行总经理，华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2009年7月10日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9日起任职）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012年8月21日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年12月25日起任职）、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日起任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014年12月23日起

任职）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年1月13日起任职）、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年2月12日起任职）、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年2月12日起任职）。

3、本公司量化投资决策委员会

主任：王路先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理、首席量化投资官，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

张弘弢先生，华夏基金管理有限公司数量投资部执行总经理，基金经理。

方军先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经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）基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券。
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保。
- （3）从事承担无限责任的投资。
- （4）向基金管理人、基金托管人出资。
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
- （6）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

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

5、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利益。

（2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

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

（五）基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1) 公司引入了独立董事制度，目前有独立董事 3 名。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2) 公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。

(3) 公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，并进行持续教育。

2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务流程的科学、合理和标准化，并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核；在岗位责任制度上，内部岗位分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置，相互检查、相互制约。

(1) 投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建，基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

① 投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

② 投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度，防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例；基金经理小组在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令，对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；交易管理部依据基金经理或基金经理授权的小组成员的指令负责交易

执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线，交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定，对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控；风险管理部进行事中的监控；监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

（2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则，建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险，制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

（3）技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行，公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

（4）人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。

（5）监察制度

公司设立了监察部门，负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度，以及对员工行为的监察。

（6）反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构，指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作；各相关部门设立了反洗钱岗位，配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外，公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程，确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4、信息沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化，不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

5、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门，通过定期或不定期检查，评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

6、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。
- （2）上述关于内部控制的披露真实、准确。
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：010-66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士

以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2015年6月30日，中国银行已托管382只证券投资基金，其中境内基金356只，QDII基金26只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：李一梅

网址：www.ChinaAMC.com

2、代销机构

（1）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

传真：010-66593777

联系人：客户服务中心

网址：www.boc.cn

客户服务电话：95566

（2）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王嘉朔

网址：www.ccb.com

（3）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

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

（4）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

电话：010-65556689

传真：010-65550827

联系人：方爽

网址：bank.ecitic.com

客户服务电话：95558

（5）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：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：021-63602431

联系人：高天、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

（6）洛阳银行股份有限公司

住所：洛阳市洛阳新区开元大道与通济街交叉口

办公地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号洛阳银行三楼 306 室

法定代表人：王建甫

电话：0379-65921977

传真：0379-65921869

联系人：董鹏程

网址：www.bankofluoyang.com.cn

客户服务电话：0379-96699

（7）烟台银行股份有限公司

住所：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

电话：0535-6699660

传真：0535-6699884

联系人：王淑华

网址：www.yantaibank.net

客户服务电话：400-831-1777

（8）河北银行股份有限公司

住所：河北省石家庄市平安北大街 28 号

办公地址：河北省石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

电话：0311-88627522

传真：0311-88627027

联系人：王栋

网址：www.hebbank.com

客户服务电话：400-612-9999

（9）苏州银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

电话：0512-69868389

联系人：项喻楠

网址：www.suzhoubank.com

客户服务电话：96067

（10）泉州银行股份有限公司

住所：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

办公地址：泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

电话：0595-22551071

传真：0595-22578871

联系人：董培姗

网址：www.qzccbank.com

客户服务电话：400-889-6312

（11）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

网址：www.txsec.com

客户服务电话：010-66045678

（12）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：陈操

电话：010-63130889-8369

传真：010-58325282

联系人：刘宝文

网址：8.jrj.com.cn

客户服务电话：400-850-7771

（13）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：021-20835787

传真：010-85657357

联系人：吴卫东

网址：licaikexun.com

客户服务电话：400-920-0022、021-20835588

（14）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

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

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

联系人：潘世友

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

（15）上海好买基金销售有限公司

住所：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

电话：021-20613635

传真：021-68596916

联系人：胡轶隼

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

（16）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：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 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818-8653

传真：0571-88910240

联系人：胡璇

网址：www.5ifund.com

客户服务电话：400-877-3772

（17）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

电话：15801816961

传真：021-50583633

联系人：张裕

网址：www.leadfund.com.cn

客户服务电话：400-067-6266

（18）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

网址：www.yixinfund.com

客户服务电话：400-609-9200

（19）万银财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人：王斐

电话：13913845654

传真：010-59393074

联系人：石军

网址：www.wy-fund.com

客户服务电话：400-081-6655

（20）深圳宜投基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号前海深港合作区管理局综合办公楼

A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 2405

法定代表人：华建强

电话：0755-23919681

传真：0755-88603185

联系人：马文静

网址：www.yitfund.com

客户服务电话：400-895-5811

（21）上海久富财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区莱阳路 2819 号 1 幢 109 室

办公地址：上海市浦东新区民生路 1403 号信息大厦 1215 室

法定代表人：赵惠蓉

电话：021-68682279 转 604

传真：021-68682297

联系人：潘静洁

网址：www.jfcta.com

客户服务电话：400-021-9898

（22）上海大智慧财富管理有限公司

住所：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

电话：021-20219536

传真：021-20219923

联系人：王悦伟

网址：www.wg.com.cn

客户服务电话：021-20219931

（23）中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

联系人：洪诚

网址：www.citicsf.com

客户服务电话：400-990-8826

（24）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

客户服务电话：400-888-8666

（25）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc.com.cn

（26）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

（27）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

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

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（28）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 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-888-8888

（29）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

客户服务电话：021-962503、400-888-8001 或拨打各城市营业网点咨询电话

（30）申万宏源证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李梅

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085599

联系人：钱达琛

网址：www.hysec.com

（31）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

（32）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

（33）西南证券股份有限公司

住所：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

电话：023-63786141

传真：023-63786212

联系人：张煜

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：400-809-6096

（34）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

传真：022-28451892

联系人：蔡霆

网址：www.bhzq.com

客户服务电话：400-651-5988

（35）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

客户服务电话：95548

（36）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：0512-33396288

（37）信达证券股份有限公司

住所：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

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：400-800-8899

（38）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

联系人：李春芳

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（39）光大证券股份有限公司

住所：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：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（40）广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：020-961303

（41）上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

网址：www.962518.com

客户服务电话：021-962518

（42）浙商证券股份有限公司

住所：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

网址：www.stocke.com.cn

客户服务电话：0571-967777

（43）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

联系人：吴琼

网址：www.pingan.com

客户服务电话：95511-8

（44）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：甘霖

网址：www.hazq.com

客户服务电话：0551-96518、400-809-6518

（45）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：95563

（46）财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

法定代表人：蔡一兵

客户服务电话：0731-4403319

传真：0731-4403349

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

（47）东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

电话：0769-22115712、0769-22119348

传真：0769-22119423

联系人：李荣、孙旭

网址：www.dgzq.com.cn

客户服务电话：0769-961130

（48）国都证券股份有限公司

住所：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

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（49）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

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

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（50）国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦 4 层

法定代表人：曾小普

电话：0791-86283080

传真：0791-86281305

联系人：俞驰

网址：www.gsstock.com

客户服务电话：0791-6285337

（51）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网址：www.jyzq.cn

客户服务电话：400-888-8228

（52）中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

网址：www.avicsec.com

客户服务电话：400-886-6567

（53）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87417129

传真：029-87424426

联系人：刘莹

网址：www.westsecu.com

客户服务电话：95582

（54）华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-4890100

联系人：李昕田

网址：www.hlzqgs.com

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

（55）中国国际金融股份有限公司

住所：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：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：010-65051166

（56）华鑫证券有限责任公司

住所：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：俞洋

电话：021-64339000-807

传真：021-64333051

联系人：陈敏

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918

（57）中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

客户服务电话：400-102-2011

（58）西藏同信证券有限责任公司

住所：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：www.xzsec.com

客户服务电话：400-881-1177

（59）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690070

传真：028-86690126

联系人：刘一宏

网址：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95105111（四川地区）、400-660-0109（全国）

（60）爱建证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 32 楼

法定代表人：钱华

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：戴莉丽

网址：www.ajzq.com

客户服务电话：021-63340678

（61）华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京西城区金融大街 8 号 A 座 3 层、5 层

法定代表人：祝献忠

电话：010-58568235

传真：010-58568062

联系人：黄恒

网址：www.hrsec.com.cn

客户服务电话：010-58568118

（62）宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

电话：028-86199278

传真：028-86199382

联系人：郝俊杰

网址：www.hxzq.cn

客户服务电话：400-836-6366

（63）太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321717、18500505235

传真：010-88321763

联系人：唐昌田

网址：www.tpyzq.com

客户服务电话：400-665-0999

（二）登记机构

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座12层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：朱威

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：杨科

经办律师：吴冠雄、杨科

（四）会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市延安东路222号30楼

办公地址：中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城德勤大楼8层

法定代表人：卢伯卿

联系电话：010-85207788

传真：010-85181218

联系人：吕静

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金已经中国证监会 2014 年 8 月 19 日证监许可[2014]870 号文准予注册。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期间为不定期。

本基金初始发售面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

本基金自 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 2 月 10 日进行发售。募集期间，本基金共募集 595,618,957.58 份基金份额，有效认购户数为 4,495 户。

七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2015 年 2 月 12 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

1、直销机构

本基金直销机构为本公司北京分公司、上海分公司、深圳分公司、南京分公司、杭州分公司、广州分公司，设在北京、上海、广州的投资理财中心以及电子交易平台。

（1）北京分公司

地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 1 层（100033）

电话：010-88087226/27/28

传真：010-88087225

（2）北京海淀投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村南大街 11 号光大国信大厦一层（100081）

电话：010-68458598/7100/8698/8998

传真：010-68458698

（3）北京朝阳投资理财中心

地址：北京市朝阳区东三环中路 24 号双井乐成中心 B 座 1 层 102（100022）

电话：010-67718442/49

传真：010-67718470

（4）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街 29 号东环广场 B 座一层（100027）

电话：010-64185181/82/83

传真：010-64185180

（5）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路 9 号（新科祥园小区大门口一层）（100190）

电话：010-82523197/98/99

传真：010-82523196

（6）北京崇文投资理财中心

地址：北京市东城区广渠门内大街 35 号（富贵园购物中心）首层东区 F1-3（100062）

电话：010-67146300/400

传真：010-67133146

（7）北京西三环投资理财中心

地址：北京市海淀区紫竹院路 88 号紫竹花园一期 B 座 01（100089）

电话：010-52723105/06/07

传真：010-52723103

（8）北京亚运村投资理财中心

地址：北京市朝阳区慧忠里 103 号洛克时代广场 A 座一层（100101）

电话：010-84871036/37/38/39

传真：010-84871035

（9）北京朝外大街投资理财中心

地址：北京市朝阳区朝外大街 6 号新城国际 6 号楼 101 号（100020）

电话：010-65336099/6579

传真：010-65336079

（10）北京东四环投资理财中心

地址：北京市朝阳区八里庄西里 100 号 1 幢 103 号（100025）

电话：010-85869585

传真：010-85869575

（11）上海分公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 101A 室（200120）

电话：021-58771599

传真：021-58771998

（12）上海联洋投资理财中心

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号第一层 101A-1 单元（200120）

电话：021-68547366

传真：021-68547277

（13）深圳分公司

地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6001 号太平金融大厦 40 层 02 室（518038）

电话：0755-82033033/88264716/88264710

传真：0755-82031949

（14）南京分公司

地址：南京市长江路 69 号江苏保险大厦一楼（210005）

电话：025-84733916/3917/3918

传真：025-84733928

（15）杭州分公司

地址：杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 105 室（310007）

电话：0571-89716606/6607/6608/6609

传真：0571-89716611

（16）广州分公司、广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 50 层 02 单元（510623）

电话：020-38067290/7291/7293/7299、020-38460001/1058/1079

传真：020-38067232、020-38461077

（17）电子交易

本公司电子交易包括网上交易、移动客户端交易等。投资者可以通过本公司网上交易系统或移动客户端办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：www.ChinaAMC.com。

2、代销机构：

本基金代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“（一）销售机构”的相关描述。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2015 年 3 月 25 日起开始办理日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

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

（三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

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

5、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等

在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

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

（四）申购与赎回的数额限制

1、投资者通过直销机构办理本基金的申购业务，每笔申购申请不得低于100.00元（含
申购费）；通过代销机构办理本基金的申购业务，每笔申购申请不得低于1,000.00元（含申购
费，定期定额不受此限制）。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于100.00份基金份额。基
金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100.00份的，在
赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量
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介上公告并报中
国证监会备案。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立，申购是
否生效以基金登记机构确认为准。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立，赎回是否生效以基金登记机构确认为准。基
金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在
发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请
日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日
提交的有效申请，投资人可在 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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到
申请。申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。

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

（六）申购费与赎回费

1、投资者在申购基金份额时需交纳前端申购费。本基金对通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

（1）通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户申购费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
50万元以下	0.24%
50万元以上（含50万元）-200万元以下	0.18%
200万元以上（含200万元）-500万元以下	0.12%
500万元以上（含500万元）	每笔1,000.00元

（2）其他投资者申购基金份额的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
50万元以下	1.2%
50万元以上（含50万元）-200万元以下	0.9%
200万元以上（含200万元）-500万元以下	0.6%
500万元以上（含500万元）	每笔 1,000.00 元

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记等各项费用。

2、本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。赎回时份额持有不满1年的，收取0.5%的赎回费，持有满1年以上（含1年）的，赎回费为0。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、移动客户端交易)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，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。

例一：假定 T 日的基金份额净值为 1.230 元。某投资者（非养老金客户）四笔申购金额分别为 1,000.00 元、50 万元、200 万元和 500 万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3
申购金额（元，a）	1,000.00	500,000.00	2,000,000.00
适用前端申购费率（b）	1.2%	0.9%	0.6%
净申购金额（c=a/(1+b)）	988.14	495,540.14	1,988,071.57
前端申购费（d=a-c）	11.86	4,459.86	11,928.43
该类基金份额净值（e）	1.230	1.230	1.230
申购份额（=c/e）	803.37	402,878.16	1,616,318.35

若该投资者申购金额为500万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购5
申购金额（元，a）	5,000,000.00
前端申购费（b）	1,000.00
净申购金额（c=a-b）	4,999,000.00
该类基金份额净值（d）	1.230
申购份额（e=c/d）	4,064,227.64

2、赎回金额的计算

当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

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

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

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

例二：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份基金份额，持有期限半年，该日基金份额净值为 1.250 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 10,000.00 \times 1.250 = 12,500.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0.5\% = 62.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 62.50 = 12,437.50 \text{元}$$

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市等特殊情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、本基金的目标 ETF 暂停估值。
- 5、本基金的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 8、法律法规或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1-6 项暂停申购情形时，基金管理人应当及时公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时

恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市等特殊情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、本基金的目标 ETF 暂停估值。
- 5、本基金的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。
- 6、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 7、法律法规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报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，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 6 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投

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

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

3、巨额赎回的公告

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

（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、如果发生暂停的时间超过 1 日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日，在至少一种指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

（十二）基金转换

1、基金转换的原则

（1）投资者只可在同时销售转出基金及转入基金的机构办理基金转换业务。

（2）基金转换以份额为单位进行申请。

（3）基金转换采取“未知价”法，即基金的转换价格以转换申请受理当日转出、转入基金的份额净值为基准进行计算。

（4）投资者 T 日申请基金转换后，T+1 日可获得确认。

(5)除另有规定外,基金份额持有人单笔转出申请遵循转出基金有关赎回份额的限制,单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

(6)发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先级,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于基金转出和基金赎回,将采取相同的比例确认;在转出申请得到部分确认的情况下,未确认的转出申请可根据投资者事先的选择和代销机构的相关规定予以顺延或撤销基金转换。

(7)投资者办理基金转换业务时,转出基金必须处于可赎回状态,转入基金必须处于可申购状态。

由于各代销机构系统及业务安排等原因,可能开展基金转换业务的时间有所不同,投资者应参照各代销机构的具体规定。

基金管理人有权根据市场情况调整转换的程序及有关限制,但应最迟在调整生效前 2 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

2、暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停基金转换业务:

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作。
- (2) 证券交易场所在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) 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回,基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请。
- (4) 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转换申请。
- (5) 基金管理人认为有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的。
- (6) 发生基金合同规定的暂停基金申购或赎回的情形。
- (7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时,基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定媒体上刊登重新开放基金转换的公告。

3、基金转换费用

- (1) 基金转换费: 无。
- (2) 转出基金费用: 按转出基金赎回时应收的赎回费收取,如该部分基金采用后端收费模式购买,除收取赎回费外,还需收取赎回时应收的后端申购费。转换金额指扣除赎回费

与后端申购费（若有）后的余额。

（3）转入基金费用：转入基金申购费用根据适用的转换情形收取，具体如下：

①从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率 = 转入基金的前端申购费率最高档 - 转出基金的前端申购费率最高档，最低为 0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例一。

②从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率，转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高，则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用；反之，收取的申购费用为 0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例二。

③从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例三。

④从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例四。

⑤从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用，转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率 = 转入基金的前端申购费率最高档 - 转出基金的前端申购费率最高档，最低为 0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例五。

⑥从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用=转入基金申购费用-转出基金申购费用，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例六。

⑦从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例七。

⑧从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例八。

⑨从后端收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例九。

⑩从后端收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高，则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用；反之，收取的申购费用为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十。

⑪从后端收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额。

费用收取方式：后端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十一。

⑫从后端收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十二。

⑬从不收取申购费用的基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的申购费率-转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间（单位为年），最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十三。

⑭从不收取申购费用基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用=固定费用-转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间（单位为年），最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十四。

⑮从不收取申购费用的基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用的基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十五。

⑯从不收取申购费用的基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的

其他不收取申购费用的基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十六。

⑰对于多笔不收取申购费用的基金份额转出情况的补充说明

上述为处理申（认）购时间不同的多笔基金份额转出的情况，对转出不收取申购费用的基金的持有时间规定如下：

(i) 对于货币型基金（目前包括华夏现金增利货币、华夏货币、华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币）和不收取赎回费用的债券型基金（目前包括华夏债券 C），每当有基金新增份额时，均调整持有时间，计算方法如下：

调整后的持有时间=原持有时间×原份额/（原份额+新增份额）

(ii) 对于除上述（i）中五只基金外的不收取申购费用的基金，其持有时间为本次转出委托中多笔份额的加权平均持有时间。

(4) 上述费用另有优惠的，从其规定。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整基金转换的有关业务规则。

4、业务举例

例一：假定投资者在 T 日转出 1,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

(1) 若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200
转出总金额（C=A*B）	1,200.00
转出基金赎回费率（D）	0.5%
转出基金费用（E=C*D）	6.00
转换金额（F=C-E）	1,194.00
转入时收取申购费率（G）	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额（H=F/(1+G）	1,188.06
转入基金费用（I=F-H）	5.94
转入基金 T 日基金份额净值（J）	1.300
转入基金份额（K=H/J）	913.89

(2) 若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	6.00
转换金额 (F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率 (G)	0.00%
净转入金额 (H=F/(1+G))	1,194.00
转入基金费用 (I=F-H)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	918.46

例二：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用比例费率，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

（1）若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	1,000.00
净转入金额 (H=F-G)	11,939,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,183,846.15

（2）若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00

转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,184,615.38

例三：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	6.00
转换金额 (F=C-E)	1,194.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	1,194.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	796.00

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，且乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (K)	796.00
赎回日基金份额净值 (L)	1.300
赎回总金额 (M=K*L)	1,034.80
赎回费用 (N)	0.00
适用后端申购费率 (O)	1.2%
后端申购费 (P=K*I*O/(1+O))	14.16
赎回金额 (Q=M-N-P)	1,020.64

例四：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%

转出基金费用(E=C*D)	6.50
转换金额 (F=C-E)	1,293.50
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	1,293.50
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	862.33

例五：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用固定费用，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.2%，赎回费率为 0.5%。

（1）若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金申购费率适用比例费率，乙基金前端申购费率最高档为 1.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入时收取申购费率 (G)	1.5%-1.2%=0.3%
净转入金额 (H=F/(1+G))	11,904,287.14
转入基金费用 (I=F-H)	35,712.86
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	9,157,143.95

（2）若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金申购费率适用比例费率，丙基金前端申购费率最高档为 1.0%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入时收取申购费率 (G)	0.00%
净转入金额 (H=F/(1+G))	11,940,000.00
转入基金费用 (I=F-H)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	9,184,615.38

例六：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金赎回费率为 0.5%。

（1）若 T 日转入乙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 500 元，乙基金适用的申购费用为 1,000 元，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200
转出总金额（C=A*B）	12,000,000.00
转出基金赎回费率（D）	0.5%
转出基金费用（E=C*D）	60,000.00
转换金额（F=C-E）	11,940,000.00
转入基金费用（G）	1,000-500=500.00
净转入金额（H=F-G）	11,939,500.00
转入基金 T 日基金份额净值（I）	1.300
转入基金份额（J=H/I）	9,184,230.77

（2）若 T 日转入丙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金适用的申购费用为 500 元，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200
转出总金额（C=A*B）	12,000,000.00
转出基金赎回费率（D）	0.5%
转出基金费用（E=C*D）	60,000.00
转换金额（F=C-E）	11,940,000.00
转入基金费用（G）	0.00
净转入金额（H=F-G）	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值（I）	1.300
转入基金份额（J=H/I）	9,184,615.38

例七：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 10,000,000 份，转入后端收费基金乙，甲基金申购费率适用固定费用，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200

转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	7,960,000.00

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，且乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (K)	7,960,000.00
赎回日基金份额净值 (L)	1.300
赎回总金额 (M=K*L)	10,348,000.00
赎回费用 (N)	0.00
适用后端申购费率 (O)	1.2%
后端申购费 (P=K*I*O/(1+O))	141,581.03
赎回金额 (Q=M-N-P)	10,206,418.97

例八：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 10,000,000 份，转入不收取申购费用基金乙，甲基金申购费率适用固定费用。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。

甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	13,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	65,000.00
转换金额 (F=C-E)	12,935,000.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	12,935,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	8,623,333.33

例九：假定投资者在 T 日转出 1,000 份持有期为半年的甲基金基金份额(后端收费模式)，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

(1)若 T 日转入乙基金(前端收费模式)，且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	19.45
转出基金费用 (I=E+H)	25.45
转换金额 (J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率 (K)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额 (L=J/(1+K))	1,168.71
转入基金费用 (M=J-L)	5.84
转入基金 T 日基金份额净值 (N)	1.300
转入基金份额 (O=L/N)	899.01

(2)若 T 日转入丙基金(前端收费模式),且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%, 该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下:

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	19.45
转出基金费用 (I=E+H)	25.45
转换金额 (J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率 (K)	0.00%
净转入金额 (L=J/(1+K))	1,174.55
转入基金费用 (M=J-L)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (N)	1.300
转入基金份额 (O=L/N)	903.50

例十：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份持有期为半年的甲基金基金份额（后端收费模式），转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

(1) 若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基

金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	60,000.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	194,499.02
转出基金费用 (I=E+H)	254,499.02
转换金额 (J=C-I)	11,745,500.98
转入基金费用 (K)	1,000.00
净转入金额 (L=J-K)	11,744,500.98
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.300
转入基金份额 (N=L/M)	9,034,231.52

(2) 若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	60,000.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	194,499.02
转出基金费用 (I=E+H)	254,499.02
转换金额 (J=C-I)	11,745,500.98
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	11,745,500.98
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.300
转入基金份额 (N=L/M)	9,035,000.75

例十一：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.0%，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。申购当日甲基金基金份额净值为 1.100 元，适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费

用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.50
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.0%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	10.89
转出基金费用 (I=E+H)	17.39
转换金额 (J=C-I)	1,282.61
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	1,282.61
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.500
转入基金份额 (N=L/M)	855.07

若投资者在 2012 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 2 年半，适用后端申购费率为 1.2%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (O)	855.07
赎回日基金份额净值 (P)	1.300
赎回总金额 (Q=O*P)	1,111.59
赎回费率 (R)	0.5%
赎回费 (S=Q*R)	5.56
适用后端申购费率 (T)	1.2%
后端申购费 (U=O*M*T/(1+T))	15.21
赎回金额 (V=Q-S-U)	1,090.82

例十二：假定投资者在 T 日转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。申购当日甲基金基金份额净值为 1.100 元，赎回费率为 0.5%，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100

适用后端申购费率 (G)	1.0%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	10.89
转出基金费用 (I=E+H)	16.89
转换金额 (J=C-I)	1,183.11
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	1,183.11
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.500
转入基金份额 (N=L/M)	788.74

例十三：假定投资者在 T 日转出持有期为 146 天的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，不收取赎回费。乙基金适用申购费率为 2.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金费用 (D)	0.00
转换金额 (E=C-D)	1,200.00
销售服务费率 (F)	0.3%
转入基金申购费率 (G)	2.0%
收取的申购费率 (H=G-F*转出基金的持有时间 (单位为年))	1.88%
净转入金额 (I=E/(1+H))	1,177.86
转入基金费用 (J=E-I)	22.14
转入基金 T 日基金份额净值 (K)	1.300
转入基金份额 (L=I/K)	906.05

例十四：假定投资者在 T 日转出持有期为 5 天的不收取申购费用基金甲 10,000,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，不收取赎回费。乙基金适用固定申购费 500 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金费用 (D)	0.00
转换金额 (E=C-D)	12,000,000.00
销售服务费率 (F)	0.3%
转入基金申购费用 (G)	500
转入基金费用 (H=G-E*F*转出基金的持有时	6.85

间（单位为年）	
净转入金额（ $I=E-H$ ）	11,999,993.15
转入基金 T 日基金份额净值（J）	1.300
转入基金份额（ $K=I/J$ ）	9,230,763.96

例十五：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金不收取赎回费。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	1,000
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200
转出总金额（ $C=A*B$ ）	1,200.00
转出基金费用（D）	0.00
转换金额（ $E=C-D$ ）	1,200.00
转入基金费用（F）	0.00
净转入金额（ $G=E-F$ ）	1,200.00
转入基金 T 日基金份额净值（H）	1.500
转入基金份额（ $I=G/H$ ）	800.00

若投资者在 2013 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 3 年半，适用后端申购费率为 1.0%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额（J）	800.00
赎回日基金份额净值（K）	1.300
赎回总金额（ $L=J*K$ ）	1,040.00
赎回费率（M）	0.5%
赎回费（ $N=L*M$ ）	5.20
适用后端申购费率（O）	1.0%
后端申购费（ $P=J*H*O/(1+O)$ ）	11.88
赎回金额（ $Q=L-N-P$ ）	1,022.92

例十六：假定投资者在 T 日转出不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.1%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.300
转出总金额（ $C=A*B$ ）	1,300.00
转出基金赎回费率（D）	0.1%

转出基金费用 (E=C*D)	1.30
转换金额 (F=C-E)	1,298.70
转入基金费用 (F)	0.00
净转入金额 (G=E-F)	1,298.70
转入基金 T 日基金份额净值 (H)	1.500
转入基金份额 (I=G/H)	865.80

（十三）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

（十四）基金的转托管

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

（十五）定期定额投资计划

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

（十六）基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

九、基金的投资

（一）投资目标

通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。

（二）标的指数

本基金的标的指数为目标 ETF 的标的指数，即 MSCI 中国 A 股指数。

未来如果目标 ETF 的标的指数发生变更，本基金不变更目标 ETF 的，则本基金的标的指数将随之变更，并可相应变更业绩基准和基金名称，不需另行召开持有人大会。

（三）投资范围

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）。

（四）投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回以及股指期货之间的投资操作，以及目标 ETF 的合并分拆，以增强基金收益。

此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以及国债期货投资。基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。

本基金可以基金资产特殊申购目标 ETF 份额，以进行基金建仓。

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

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（五）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。
- (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%。
- (4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。
- (5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%。
- (6) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。
- (7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。
- (8) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。
- (9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期。
- (10) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。
- (11) 基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。
- (12) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

(13) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(15) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

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 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券。
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保。
- (3) 从事承担无限责任的投资。
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资。
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。
- (6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其它活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $MSCI$ 中国 A 股指数收益率 $\times 95\%$ + 人民币活期存款税后利率 $\times 5\%$ 。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

(七) 风险收益特征

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

（八）基金的融资、融券、转融通

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资、融券以及参与转融通等相关业务，不需召开持有人大会。

（九）目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，不需召开持有人大会；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，履行适当的程序后可选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标 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 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现。
- 2、目标 ETF 终止上市。
- 3、目标 ETF 基金合同终止。
- 4、目标 ETF 与其他基金进行合并。
- 5、目标 ETF 的基金管理人发生变更。
- 6、中国证监会规定的其他情形。

（十）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2015 年第 2 季度报告：

“5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,918,677.69	2.45
	其中：股票	6,918,677.69	2.45
2	基金投资	237,859,301.53	84.37
3	固定收益投资	15,984.10	0.01
	其中：债券	15,984.10	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,700,146.86	6.99

8	其他各项资产	17,425,095.63	6.18
9	合计	281,919,205.81	100.00

5.2 报告期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	MSCI 中国 A 股 ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	237,859,301.53	91.92

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,664.60	0.00
B	采矿业	42,262.81	0.02
C	制造业	3,792,376.73	1.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	342,101.24	0.13
F	批发和零售业	262,818.85	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	8,955.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	285,443.48	0.11
J	金融业	1,283,518.46	0.50
K	房地产业	130,556.34	0.05
L	租赁和商务服务业	627,305.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	140,004.00	0.05
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	714.38	0.00
S	综合	956.80	0.00
	合计	6,918,677.69	2.67

5.4 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	43,693	952,507.40	0.37
2	600887	伊利股份	39,804	752,295.60	0.29
3	000625	长安汽车	27,600	583,740.00	0.23
4	601888	中国国旅	5,600	371,280.00	0.14
5	600741	华域汽车	16,600	354,410.00	0.14
6	000503	海虹控股	5,500	269,500.00	0.10
7	600271	航天信息	4,100	265,311.00	0.10
8	600827	百联股份	12,600	262,206.00	0.10
9	002183	怡亚通	3,500	256,025.00	0.10
10	000630	铜陵有色	22,000	227,040.00	0.09

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,984.10	0.01
8	其他	-	-
9	合计	15,984.10	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	110	15,984.10	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-

5	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位:手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1507	IC1507	1	1,668,720.00	-401,360.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1507	IF1507	-1	-1,313,040.00	133,440.00	买入股指期货空头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-267,920.00
股指期货投资本期收益					-400.00
股指期货投资本期公允价值变动					-267,920.00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 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。

5.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	426,831.45
2	应收证券清算款	13,405,439.42
3	应收股利	-
4	应收利息	3,144.06
5	应收申购款	3,589,680.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,425,095.63

5.12.4 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。

5.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	256,025.00	0.10	筹划重大事项

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

十、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

阶 段	净值增 长率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
2015 年 2 月 12 日至 2015 年 6 月 30 日	22.70%	2.07%	33.06%	2.15%	-10.36%	-0.08%

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

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

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

十二、基金资产的估值

（一）估值日

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

（二）估值对象

基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

1、目标 ETF 估值方法

本基金投资的目标 ETF 份额按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述价格不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规

定确定公允价值。

4、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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

9、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，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。

（五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值

错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

损失。

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

3、基金所投资的目标 ETF 暂停估值或暂停公告基金份额净值时。

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）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估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

十三、基金的收益与分配

（一）基金收益分配原则

1、每一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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

（二）收益分配方案

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

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

（四）基金收益分配中发生的费用

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

十四、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费。
- （2）基金托管人的托管费。
- （3）标的指数许可使用费。
- （4）基金上市费及年费（如有）。
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

- (6) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
- (7) 基金份额持有人大会费用。
- (8) 基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申购赎回费用等）。
- (9) 基金的证券交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等)。
- (10) 基金的银行汇划费用。
- (11) 基金收益分配中发生的费用。
- (12) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不需召开持有人大会，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发

送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（3）标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

本基金目前不收取指数许可使用费。

如果将来按照指数使用许可协议约定本基金需收取指数使用费，基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金的指数使用费率、计算方法等。

（4）本条第（一）款第 1 项中第（4）至第（11）项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

（3）《基金合同》生效前的相关费用。

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（二）基金销售费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（六）申购费与赎回费”与“（七）申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

本基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（十二）基金转换”中的相关规定。

（三）税收

基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方。

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。

- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关会计制度。
- 5、本基金独立建账、独立核算。
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

十六、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媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
- 2、对证券投资业绩进行预测。
- 3、违规承诺收益或者承担损失。
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构。

5、登载任何自然人、法人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、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 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介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

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

3、《基金合同》生效公告

基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

《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、基金份额销售网点以及其他媒介，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介上。

5、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销售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、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介上。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介上。

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介上。

《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或书面报告方式。

7、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的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。
- (8) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十。
- (9) 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百分之三十。
- (10) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。
- (11) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查。
- (12) 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。
- (13) 重大关联交易事项。
- (14) 基金收益分配事项。
- (15) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更。
- (16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五。
- (17) 基金改聘会计师事务所。
- (18) 变更基金销售机构。
- (19) 更换基金登记机构。
- (20) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更。
- (21) 本基金发生巨额赎回并延期支付。
- (22) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请。
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回。
- (24) 变更标的指数。
- (25) 基金份额的拆分。
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

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

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

10、中国证监会规定的其他信息。

基金将按照中国证监会的有关规定在定期报告等文件中披露股指期货、中小企业私募债券、国债期货等的投资情况。

（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媒介中选择披露信息的媒介。

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

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

（七）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。

（八）法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。

十七、风险揭示

（一）投资于本基金的主要风险

1、本基金的特有风险

（1）联接基金风险

本基金为 ETF 联接基金，基金资产主要投资于目标 ETF，在多数情况下将维持较高的目标 ETF 投资比例，基金净值可能会随目标 ETF 的净值波动而波动，目标 ETF 的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

（2）跟踪偏离风险

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：

- ①目标 ETF 与标的指数的偏离。
- ②基金买卖目标 ETF 时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击。
- ③基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。
- ④基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。
- ⑤基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。
- ⑥基金的管理费和托管费所产生的跟踪误差。
- ⑦其他因素所产生的偏差。

（3）与目标 ETF 业绩差异的风险

本基金为目标 ETF 的联接基金，但由于投资方法、交易方式等方面与目标 ETF 不同，本基金的业绩表现与目标 ETF 的业绩表现可能出现差异。

（4）其他投资于目标 ETF 的风险

如目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、目标 ETF 退市风险、申购赎回失败风险等等。

2、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括：

- （1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。
- （2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。
- （3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括：

- （1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。
- （2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。
- （3）债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

3、流动性风险

在目标 ETF 暂停交易或者暂停申购、赎回或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多所导致的收益下降风险。

4、操作或技术风险

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

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

5、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

6、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

（二）声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但是，本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

3、本基金并非由 MSCI INC. (“MSCI”)、其任何关联机构、其任何信息提供方或参与或涉及收集、计算或创建任何 MSCI 指数的任何其他第三方（统称“MSCI 各方”）保荐、担保、销售或推介。MSCI 指数是 MSCI 的专有财产。MSCI 名称和 MSCI 指数名称均是 MSCI 或其关联机构的服务标识，并已经许可给[被许可方]为特定目的使用。MSCI 各方均未就一般的基金投资或特别针对投资本基金的行为是否明智或者任何 MSCI 指数跟踪相应股票市场表现的能力向本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体作出任何明示或默示的陈述或保证。MSCI 或其关联机构是若干商标、服务标记和商号的许可方，也是由 MSCI 在未考虑本基金或本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体的情况下确定、编制和计算的 MSCI 指数的许可方。在确定、编制和计算 MSCI 指数时，MSCI 各方均无义务考虑本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体的需要。MSCI 各方均不负责也未参与确定本基金的发行时间、发行价格或数量，或本基金赎回公式或赎回对价的确定或计算。而且，MSCI 各方均不就本基金的管理、营销或发售向本基金的发行人或所有人或任何其他个人或实体承担任何义务或责任。

尽管 MSCI 应自其认为可靠的来源获取 MSCI 指数中包含的或用来计算 MSCI 指数的信息，MSCI 各方均不保证或担保任何 MSCI 指数或其中包含的任何数据的独创性、准确性及/或完整性。MSCI 各方未就本基金的发行人、本基金的所有人或任何其他个人或实体使用 MSCI 指数或其中包含的任何数据时将会获得的结果作出任何明示或默示的担保。MSCI 各方均不会就 MSCI 指数或其中包含的任何数据的任何差错、遗漏或中断或与 MSCI 指数或其中包含的任何数据有关的任何差错、遗漏或中断承担任何责任。此外，MSCI 各方均未作出任何类型的明示或默示的保证，并且 MSCI 各方特此明确表示不对每一 MSCI 指数及其中包含的任何数据作出任何适销性和对特定用途的适用性的任何保证。不限制前述任何规定，即使已被告知发生以下损害赔偿的可能性，在任何情况下 MSCI 各方均不就任何直接的、间接的、特别的、惩罚性、推定性或任何其他损害赔偿（包括利润损失）承担任何责任。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金。
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认。
- （3）对基金财产进行估值和变现。
- （4）制作清算报告。
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（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。

十九、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》：

“第七部分 基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

成立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

存续期限：100 年

联系电话：400-818-6666

（二）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集基金。
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产。
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用。
- （4）销售基金份额。
- （5）召集基金份额持有人大会。
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益。
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人。
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理。
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用。
- （10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案。
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请。
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利。
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券和转融通等业务。
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构。
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则。
- （17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续。

(3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督。

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告。

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项。

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

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

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

- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人。
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿。
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任。
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为。
- (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人。
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议。
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册。
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人

（一）基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

（二）基金托管人的权利与义务

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

- (1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财

产。

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会。

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人。

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产。

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证。

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格。

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施。

- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上。
- (12) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对。
- (13) 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。
- (14) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会。
- (15) 按照法律法规和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作。
- (16) 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。
- (17) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人。
- (18) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。
- (19) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿。
- (20) 执行生效的基金份额持有人大会的决定。
- (21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益。
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产。
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额。
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会。
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权。
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料。

- (7) 监督基金管理人的投资运作。
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁。

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》。
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险。
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务。
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用。
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任。
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动。
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定。
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利。
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第八部分 基金份额持有人大会

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

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (2) 更换基金管理人。
- (3) 更换基金托管人。
- (4) 转换基金运作方式（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。
- (6) 变更基金类别。
- (7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。

除外）。

（9）变更基金份额持有人大会程序（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）。

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会。

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

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

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

2、在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费。

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取。

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率或收费方式。

（4）增加、减少、调整基金份额类别设置。

（5）调整基金份额净值的计算和公告时间或频率。

（6）本基金采取其他方式参与目标 ETF 的申购赎回。

（7）在条件允许的情况下，安排基金份额的上市交易。

（8）基金管理人、证券交易所、登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则。

（9）基金推出新业务或服务。

（10）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改。

（11）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化。

（12）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式。
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式。
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日。
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点。
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话。
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续。
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会或通讯开会等方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 1/2 (含 1/2)。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会,应当有代表 1/3 以上(含 1/3)基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并(法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外)、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,

然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 5 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

七、计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

八、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效后 2 日内按照法律法规和中国证监会相关规定的要求在指定媒介上公告。

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

九、关于本基金所持目标 ETF 份额行使表决权的方式

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行使与目标 ETF 相关的持有人权利，如目标 ETF 持有人大会召集权、参加目标 ETF 持有人大会的表决权。计算参会份额和计票时，本基金基金份额持有人的参会份额数和票数按

权益登记日本基金所持有的目标 ETF 的基金份额、该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例折算。本基金持有人，如经基金管理人确认其单独或合计持有的联接基金份额所对应的目标 ETF 份额不少于目标 ETF 总份额的 10% 的，可对目标 ETF 行使基金份额持有人大会的召集权。

如目标 ETF 召开基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人有权亲自出席/出具书面表决意见或以代理投票授权委托书委派代表出席/出具书面表决意见，并有权按照所持有的本基金基金份额对应的目标 ETF 份额参与投票表决。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的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。

十、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的。

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的。

3、《基金合同》约定的其他情形。

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金。

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认。

- (3) 对基金财产进行估值和变现。
- (4) 制作清算报告。
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

第二十一部分 争议的处理和适用的法律

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

《基金合同》受中国法律管辖。

第二十二部分 基金合同的效力

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

二十、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》：

“一、托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

成立时间：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）中国证监会核准的

其他业务

存续期间：100 年

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库、等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

2、对基金投融资比例进行监督：

（1）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%。

（2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。

(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%。

(4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。

(5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%。

(6) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

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

(8) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期。

(10) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。

(11) 基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

(12) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

(13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(14) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

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 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟、股权分置改革中支付对价

等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及本协议的约定，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复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及本协议的约定，应及时提示基金管理人限期纠正，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

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

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

四、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的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、无

正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并及时回复基金管理人。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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

五、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入本基金的银行账户。

（三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。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，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人和基金托管人以基金名义在相关法规规定范围内的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。若基金托管人认为存款银行存在风险，可与基金管理人协商解决。若无法达成一致意见，可向监管部门报告。

（五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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

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

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

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

（六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

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

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正

本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

八、基金资产净值的计算和复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

十二、基金份额持有人名册的保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册。
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册。
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册。
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

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

十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

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

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

十八、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。”

二十一、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

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

（一）资料发送

1、基金交易对账单

基金管理人根据持有人账单订制情况向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人在本公司未详实填写或更新客户资料（含姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。

2、其他相关的信息资料

指随基金交易对账单不定期发送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、客户服务问答等。

（二）电子交易

持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡、中国工商银行借记卡、中国银行借记卡、招商银行储蓄卡、交通银行太平洋借记卡、兴业银行借记卡、民生银行借记卡、浦发银行东方卡/活期账户一本通、广发银行借记卡、上海银行借记卡、平安银行借记卡、中

国邮政储蓄银行借记卡、华夏银行借记卡等银行卡的个人投资者，开通天天盈账户、支付宝基金专户等第三方支付账户的个人投资者，以及在华夏基金投资理财中心开户的个人投资者，在登录本公司网站（www.ChinaAMC.com）或本公司移动客户端，与本公司达成电子交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可办理基金账户开立、基金申购、赎回、转换、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

（三）电子邮件及短信服务

投资者在申请开立本公司基金账户时如预留准确的电子邮箱地址、手机号码，将不定期通过邮件、短信形式获得市场资讯、产品信息、公司动态等服务提示；同时，如需订制个性化服务，可通过本公司网站、邮件、短信、人工等方式操作。

（四）呼叫中心

1、自动语音服务

提供每周7天、每天24小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新热点问题、基金份额净值、基金账户余额等信息。

2、人工电话服务

提供每周7天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为8：30~21：00，周六至周日的人工电话服务时间为8：30~17：00，法定节假日除外。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

（五）在线服务

通过本公司网站，投资者可获得如下服务：

1、查询服务

投资者可登录本公司网站“基金账户查询”，查询基金账户情况、更改个人信息、订制个性化服务。

2、在线客服

投资者可点击本公司网站“在线客服”，进行咨询。周一至周五的在线客服人工服务时间为8：30~21：00，周六至周日的在线客服人工服务时间为8：30~17：00，法定节假日除外。

3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管

理人最新动态、热点问题等。

公司网址：www.ChinaAMC.com

电子信箱：service@ChinaAMC.com

（六）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

二十二、其他应披露事项

（一）2015年2月13日发布MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告。

（二）2015年3月5日发布华夏基金管理有限公司公告。

（三）2015年3月19日发布华夏基金管理有限公司公告。

（四）2015年3月25日发布MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

（五）2015年3月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增苏州银行股份有限公司为代销机构的公告。

（六）2015年3月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增太平洋证券股份有限公司为代销机构的公告。

（七）2015年4月22日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构的公告。

（八）2015年4月27日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告。

（九）2015年5月9日发布华夏基金管理有限公司公告。

（十）2015年6月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增洛阳银行股份有限公司为代销机构的公告。

（十一）2015年6月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告。

（十二）2015年6月24日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告。

（十三）2015年7月15日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增泉州银行股份有限公司为代销机构的公告。

（十四）2015年7月18日发布MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年第2季度报告。

（十五）2015年7月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中信期货有限公司为代销机构的公告。

（十六）2015年8月1日发布华夏基金管理有限公司公告。

（十七）2015年8月17日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大连银行股份有限公司为代销机构的公告。

（十八）2015年8月22日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

（十九）2015年8月29日发布MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年半年度报告。

（二十）2015年9月11日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告。

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，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印件。

二十四、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件。
- 2、《MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。
- 3、《MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一五年九月二十五日