

# 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年第 1 号招募说明书

## 【重要提示】

(一) 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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”）由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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”）及其他有关规定募集，并经中国证监会 2018 年 3 月 27 日证监许可【2018】549 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2018 年 5 月 16 日正式生效。

(二) 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

(五) 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。

(六) 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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

(七) 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，请认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险，等等。

本基金为景顺长城MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“景顺长城MSCI中国A股国际通ETF”）的联接基金。目标ETF为股票型指数基金，因此本基金与景顺长城MSCI中国A股国际通ETF在投资方法、交易方式和业绩表现等方面存在着联系和区别。本基金对景顺长城MSCI中国A股国际通ETF的投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。投资者在进行投资决策前，应仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

（八）本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年11月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。本招募说明书中财务数据未经审计。

**基金管理人：景顺长城基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

## 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	18
第五部分	相关服务机构	22
第六部分	基金的募集	42
第七部分	基金合同的生效	45
第八部分	基金份额的申购、赎回与转换	47
第九部分	基金的投资	58
第十部分	基金的业绩	67
第十一部分	基金的财产	69
第十二部分	基金资产的估值	70
第十三部分	基金的收益与分配	75
第十四部分	基金费用与税收	77
第十五部分	基金的会计与审计	80
第十六部分	基金的信息披露	81
第十七部分	风险揭示	87
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	93
第十九部分	基金合同的内容摘要	95
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	110
第二十一部分	对基金份额持有人的服务	121
第二十二部分	其他应披露事项	123
第二十三部分	招募说明书存放及查阅方式	125
第二十四部分	备查文件	126

## 第一部分 绪言

《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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”）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》等相关法律法规以及基金合同等编写。

本招募说明书阐述了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资目标、投资策略、风险、费率、管理等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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：指景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、目标 ETF：指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（以下简称“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。本基金以景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF。

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

4、基金管理人：指景顺长城基金管理有限公司。

5、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司。

6、基金合同或《基金合同》：指《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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 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，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》

修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。

12、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《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》及颁布机关对其不时做出的修订。

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

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、转托管及定期定额投资等业务。

24、销售机构：指景顺长城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。基金的登记机构为景顺长城基金管理有限公司或接受景顺长城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办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致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《景顺长城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 and 投资人共同遵守。

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

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将基金份额兑换为现金的行为。

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受理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。

54、标的指数：指 MSCI 公司编制并发布的 MSCI 中国 A 股国际通指数及其未来可能发生的变更，或基金管理人根据需要更换的其他指数。

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

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

57、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。



### 第三部分 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

设立日期：2003 年 6 月 12 日

法定代表人：丁益

注册资本：1.3 亿元人民币

批准设立文号：证监基金字 [2003] 76 号

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

电话：0755-82370388

客户服务电话：400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨皞阳

股东名称及出资比例：

序号	股东名称	出资比例
1	长城证券股份有限公司	49%
2	景顺资产管理有限公司	49%
3	开滦（集团）有限责任公司	1%
4	大连实德集团有限公司	1%
合计		100%

#### 二、主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

丁益女士，董事长，经济学博士。曾担任中国人民大学财政金融学院讲师；华能国际电力股份有限公司证券融资部干部，证券融资部投资关系处副处长、处长，证券融资部副经理兼投资关系处处长；中国人民保险公司投资管理部副总经理；中国人保资产管理有限公司党委委员、董事、总裁助理；华能资本常务副总经理（主持工作）、党组副书记；华能资本总经理、党组副书记。现任华能资本服务有限公司董事长、党组书记，长城证券股份有限公司董

事长。

康乐先生，董事，总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司董事兼总经理。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House 亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员，并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间，担任香港联交所委员会成员，并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

李翔先生，董事，高级管理人工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

伍同明先生，独立董事，文学学士。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977 受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师事务所”[KPMG]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打律师行、英国律师行 Clyde & Co. 从事律师工作，1993年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

闵路浩先生，独立董事，经济学硕士。曾担任中国人民银行金融管理公司科员、主任科员；中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行业监督管理委员会非银行金融机构监管部处长、副巡视员、巡视员；中国小额贷款公司协会会长；重庆富民银行行长。现担任北京中泰创汇股权投资基金管理有限公司总裁。

## 2、基金管理人监事会成员

阮惠仙女士，监事，会计学硕士。现任长城证券股份有限公司财务部总经理。

郭慧娜女士，监事，管理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生，监事，工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

丁益女士，董事长，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

CHEN WENYU（陈文宇），副总经理，工商管理硕士。曾担任中国海口电视台每日新闻记者及每周金融新闻节目制作人，安盛罗森堡投资管理公司（美国加州）美洲区副首席投资官、以及研究、投资组合管理和策略等其他多个职位，安盛投资管理亚洲有限公司（新加坡）泛亚地区首席投资官，主要负责投资组合管理、研究、交易等相关业务。2018年9月加入本公司，现任公司副总经理。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部，担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

黎海威先生，副总经理，经济学硕士。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，现任公司副总经理。

赵代中先生，副总经理，理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏嘉川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事会境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副总经理。2016年3月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。曾担任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

杨皦阳先生，督察长，法学硕士。曾担任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，

南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经理、总监助理。2008 年 10 月加入本公司，现任公司督察长。

#### 4、本基金基金经理简历

徐喻军先生，理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 8 年证券、基金行业从业经验。

#### 5、本基金基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金基金经理徐喻军先生曾于 2014 年 4 月至 2018 年 5 月管理景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金；2014 年 4 月至 2018 年 7 月管理景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

#### 6、本基金基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金基金经理徐喻军先生兼任上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

#### 7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

无。

#### 8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

康乐先生，总经理；

CHEN WENYU（陈文宇），副总经理；

毛从容女士，副总经理；

黎海威先生，副总经理兼量化及指数投资部投资总监；

余广先生，总经理助理兼股票投资部投资总监；

刘彦春先生，总经理助理兼研究部总监；

陈文鹏先生，固定收益部投资总监。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的权利和义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

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

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(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；

(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、转换和非交易过户等的业务规则；

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，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活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、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、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《中华人民共和国证券法》、《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) 利用基金财产或职务之便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) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

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利益；
- (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，不按照规定履行职责；

(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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- (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、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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(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

##### 1、风险管理理念与目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护投资者和股东的合法权益。

##### 2、风险管理措施

- (1) 建立健全公司组织架构；
- (2) 树立监察稽核功能的权威性和独立性；
- (3) 加强内控培训，培养全体员工的风险管理意识和监察文化；
- (4) 制定员工行为规范和纪律程序；
- (5) 建立岗位分离制度；
- (6) 建立危机处理和灾难恢复计划。

##### 3、风险管理和内部控制的原则

(1) 全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

(2) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

(5) 防火墙原则：基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

#### 4、内部控制体系

##### (1) 内部控制的组织架构

1) 董事会审计与风险控制委员会：负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。该委员会主要职责是：审议并批准公司内控制度和政策并检查其实施情况；监督公司内部审计制度的实施；向董事会提名外部审计机构；负责内部审计和外部审计之间的协调；审议公司的关联交易；对公司的风险及管理状况及风险管理能力及水平进行评价，提出完善风险管理和内部制度的意见、制定公司日常经营、拟募集基金及运用基金资产进行投资的风险控制指标和监督制度，并不定期地对风险控制情况进行检查和监督，形成风险评估报告和建议，在例行董事会会议上提出公司上半个年度风险控制工作总结报告；监督和指导经理层所设立的风险管理委员会的工作及董事会赋予的其他职责。

2) 风险管理委员会：是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，负责公司整体运作风险的评估和控制，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。

3) 投资决策委员会：是公司投资领域的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题。投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成，其主要职责包括：依照基金合同、资产管理合同的规定，确立各基金、特定客户资产管理的投资方针及投资方向；审定基金资产、特定客户资产管理的配置方案，包括基金资产、特定客户资产管理在股票、债券、现金之间的配置比例；制定基金、特定客户资产管理投资授权方案；对超出投资负责人权限的投资项目做出决定；考核包括基金经理、投资经理在内的投资团队的工作绩效；需要投资决策委员会决定的其它

重大投资事项。

4) 督察长：督察长制度是基金管理人特有的制度。督察长负责组织指导公司的监察稽核工作；可列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核；每月独立出具稽核报告，报送中国证监会和董事长。

5) 法律、监察稽核部：公司设立法律、监察稽核部，开展公司的监察稽核工作，并保证其工作的独立性和权威性，充分发挥其职能作用。法律、监察稽核部有权对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行检查并提出相应意见和建议，并将意见和建议上报公司总经理、督察长和风险管理委员会进行讨论。法律、监察稽核部协助对全体员工进行相关法律、法规、规章制度培训，回答公司各部门提出的法律咨询，并对公司出现的法律纠纷提出解决方案，同时组织各部门对公司管理上存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究，提出解决方案，提交风险管理委员会、投资决策委员会或总经理办公会等进行审核、讨论，并监督整改。

## (2) 内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则：

1) 健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司设立独立的法律、监察稽核部，法律、监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制订内部控制制度遵循以下原则：

1) 合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

2) 全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

### （3）内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来，根据中国证监会的要求，借鉴外方股东的经验，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修改，公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

建立健全了管理制度和业务规章。公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

建立了岗位分离、相互制衡的内控机制。公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易，交易与清算，公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

建立健全了岗位责任制。公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

构建了风险管理系统。公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统：公司启用了电子化投资、交易系统，对投资比例进行限制，在“股票黑名单”、交叉交易以及防范操守风险等方面进行电子化自动控制，将有效地防止合规性运作风险和操守风险。

使用数量化的风险管理手段。采用数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、规避和控制，尽可能减少损失。

提供足够的培训。制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工具有较高的职业水准，从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

### 5、基金管理人关于内部控制制度的声明

基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

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：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：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

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，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”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”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，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 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。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 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 419 只。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 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。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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。

### 四、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户和证券账户等投资所需账户、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等投资所需账户，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；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其



退任而免除；

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：景顺长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

办公地址：深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

法定代表人：丁益

批准设立文号：证监基金字 [2003] 76 号

电话：0755-82370388-1663

传真：0755-22381325

联系人：周婷

客户服务电话：0755-82370688、4008888606

网址：www.igwfmc.com

注：直销机构包括本公司深圳直销中心及直销网上交易系统/电子交易直销前置式自助前台（具体以本公司官网列示为准）

#### 2、其他销售机构

序号	全称	销售机构信息
----	----	--------

1	中国农业银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：周慕冰 联系人：张伟 电话：010-85109219 传真：010-85109219 客户服务电话：95599 网址：www.abchina.com
2	中国银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 联系人：宋亚平 客户服务电话：95566（全国） 网址：www.boc.cn
3	交通银行股份有限公司	住所（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号 法定代表人：彭纯 联系人：王菁 电话：021-58781234-1601 传真：021-58408483 客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com
4	招商银行股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号 法定代表人：李建红 联系人：邓炯鹏 客户服务电话：95555 网址：www.cmbchina.com
5	广发银行股份有限公司	注册（办公）地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：杨明生 客户服务电话：400 830 8003 网址：www.cgbchina.com.cn
6	中国民生银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：洪崎 联系人：穆婷 联系电话：010-58560666 传真：010-57092611 客户服务热线：95568 网址：www.cmbc.com.cn

7	平安银行股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 法定代表人：孙建一 联系人：张莉 电话：021-38637673 传真：021-50979507 客户服务电话：95511-3 网址：www.bank.pingan.com
8	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号 办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦 法定代表人：李伏安 联系人：王宏 联系电话：022-58316666 传真：022-58316259 客户服务热线：95541 网址：www.cbhb.com.cn
9	嘉兴银行股份有限公司	注册（办公）地址：嘉兴市建国南路 409 号 法定代表人：许洪明 联系人：陈兢 电话：0573-82082676 传真：0573-82062161 客户服务电话：057396528 银行网址：www.bojx.com
10	包商银行股份有限公司	注册（办公）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 法定代表人：李镇西 联系人：张建鑫 电话：010-64816038 传真：010-84596546 客服电话：95352 网站：www.bsb.com.cn
11	苏州银行股份有限公司	注册（办公）地址：苏州工业园区钟园路 728 号 法定代表人：王兰凤 联系人：葛晓亮 传真：0512-69868370 客户服务电话：0512-96067 网址：www.suzhoubank.com
12	上海农村商业银行股份有限公司	注册(办公)地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号 法定代表人：冀光恒 客户服务电话：021-962999、4006962999 网址：www.srcb.com

13	恒丰银行股份有限公司	注册（办公）地址：中国烟台市芝罘区南大街 248 号 法定代表人：蔡国华 联系人：李胜贤 电话：021-63890179 传真：021-63890196 客户服务电话：95395 网址：www.hfbank.com.cn
14	四川天府银行股份有限公司	注册地址：四川省南充市涪江路 1 号 办公地址：四川省成都市锦江区下东大街 258 号 法定代表人：邢敏 联系人：樊海波 电话：028-67676033 客户服务电话：4001696869 网址：www.tf.cn
15	华鑫证券有限责任公司	注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 4018 号 安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 法定代表人：俞洋 联系人：朱泽乾 电话：021-54967367 传真：021-54967032 客户服务电话：95323, 4001099918（全国） 021-32109999； 029-68918888 网址：www.cfsc.com.cn
16	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客户服务电话：4006-788-887 网址：众禄基金网 www.zlfund.cn 基金买卖网 www.jjmmw.com
17	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F 法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客户服务电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn

18	诺亚正行基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋 法定代表人：汪静波 联系人：方成 电话：021-38602377 传真：021-38509777 客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
19	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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙焱 电话：021-20691832 传真：021-20691861 客服电话：400-820-2899 公司网站：www.erichfund.com
20	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 4494 办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-58870011 传真：021-68596916 客户服务电话：400 700 9665 网址：www.ehowbuy.com
21	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层 法定代表人：闫振杰 联系人：李晓芳 联系电话：010-59601366 转 7167 客服电话：400-818-8000 公司网站：www.myfund.com
22	和讯信息科技有限公司	注册（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 联系人：习甜 联系电话：010-85650920 传真号码：010-85657357 全国统一客服热线：400-920-0022/

		<p>021-20835588 公司网址: <a href="http://licaike.hexun.com">licaike.hexun.com</a></p>
23	上海天天基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号东方财富大厦 2 楼 办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座(北楼) 25 层 法定代表人: 其实 联系人: 潘世友 电话: 021-54509977-8400 传真: 021-54509953 客服电话: 400-1818-188 网址: <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a></p>
24	浙江同花顺基金销售有限公司	<p>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 传真: 0571-86800423 客服电话: 4008-773-772 网址: <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a></p>
25	众升财富(北京)基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室 办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人: 李招弟 联系人: 高晓芳 电话: 010-59393923 传真: 010-64788105 客户服务电话: 400-059-8888 网址: <a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a></p>

26	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	注册地址：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 1809 室 法定代表人：沈伟桦 联系人：王巨明 电话：010-52855713 传真：010-85894285 客户服务电话：400-609-9200 网址：www.yixinfund.com
27	北京增财基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室 办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室 法定代表人：罗细安 联系人：孙晋峰 电话：010-67000988 传真：010-67000988-6000 客户服务电话：400-001-8811 网址：www.zcvc.com.cn
28	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	注册（办公）地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室 法定代表人：陈洪生 联系人：梁云波 联系电话：0592-3122757 客服电话：400-9180808 公司网站：www.xds.com.cn
29	嘉实财富管理有限公司	注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元 法定代表人：赵学军 联系人：景琪 电话：021-20289890 传真：010-85097308 客户服务电话：400-021-8850 网址：www.harvestwm.cn
30	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# 办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层 法定代表人：马勇 电话：0755-88394666 传真：0755-88394677 客户服务电话：400-166-1188 网址：http://8.jrj.com.cn/

31	一路财富（北京）信息科技有限公司	注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 法定代表人：吴雪秀 联系人：段京璐 电话：010-88312877 传真：010-88312885 客户服务电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com
32	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室 法定代表人：周斌 电话：010-59313555 传真：010-53509643 客户服务电话：400-8980-618 网址：www.chtwm.com
33	北京钱景基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人：赵荣春 联系人：陈剑炜 电话：010-57418813 传真：010-57569671 客户服务电话：400-875-9885 网址：www.qianjing.com
34	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 办公地址：北京市西城区民白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室 法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清 电话：010-66154828 传真：010-63583991 客户服务电话：400-6262-1818 网址：www.5irich.com
35	上海联泰资产管理有限公司	注册地址：上海自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室 办公地址：上海市长宁区金钟路 658 号 2 号楼 B 座 6 楼 法定代表人：燕斌 联系人：凌秋艳 电话：13636316950 传真：021-62990063



		<p>客户服务电话：400-046-6788 网址：www.66zichan.com</p>
36	上海汇付基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室 办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人：张晶 联系人：周丹 电话：021-33323999 传真：021-33323993 客户服务电话：400-820-2819 手机客户端：天天盈基金</p>
37	上海利得基金销售有限公司	<p>注册地址：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：李兴春 联系人：徐鹏 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客户服务电话：400-921-7755 公司网址：www.leadfund.com.cn</p>
38	北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室 法定代表人：张欢行 联系人：李昭琛 电话：010-82244185 客户服务电话：010-62675369 网址：http://www.xincai.com/</p>
39	泰诚财富基金销售（大连）有限公司	<p>注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海 中龙园 3 号 法定代表人：林卓 联系人：薛长平 电话：0411-88891212 传真：0411-84396536 客户服务电话：4006411999 网址：www.taichengcaifu.com</p>

40	上海陆金所基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 法定代表人：王之光 联系人：宁博宇 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客户服务电话：4008219031 网址：www.lufunds.com
41	北京虹点基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603 办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层 法定代表人：郑毓栋 联系人：姜颖 电话：010-56409010 客户服务电话：400-068-1176 网址：www.hongdianfund.com
42	珠海盈米基金销售有限公司	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491 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 12 楼 B1201-1203 法定代表人：肖雯 联系人：黄敏嫦 电话：020-89629099 传真：020-89629011 客户服务电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn
43	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层 法定代表人：钱昊旻 联系人：孙雯 电话：010-59336519 传真：010-59336500 客户服务电话：4008-909-998 网址：www.jnlc.com

44	奕丰基金销售有限公司	注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入住深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人: TAN YIK KUAN 联系人: 叶健 电话: 0755-89460500 传真: 0755-21674453 客户服务电话: 400-684-0500 网址: www.ifastps.com.cn
45	和耕传承基金销售有限公司	注册(办公)地址: 河南省郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场 2 号楼 701 法定代表人: 李淑慧 联系人: 裴小龙 电话: 0371-55213196 传真: 0371-85518397 客户服务电话: 400-0555-671 网址: www.hgccpb.com
46	深圳市金斧子基金销售有限公司	注册地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 办公地址: 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 7 层 法人代表: 赖任军 联系人: 刘昕霞 电话: 0755-29330513 传真: 0755-26920530 客服电话: 400-930-0660 公司网址: www.jfzinv.com
47	武汉市伯嘉基金销售有限公司	注册(办公)地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 栋 23 层 1 号、4 号 法定代表人: 陶捷 联系人: 孔繁 电话: 18672739925 客户服务电话: 027-87006003 网址: www.buyfunds.cn
48	北京汇成基金销售有限公司	注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号 办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 法定代表人: 王伟刚 客服电话: 400-619-9059 公司网址: www.hcjijin.com

49	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人：钱燕飞 联系人：王锋 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699 客户服务电话：95177 网址：www.snjjin.com
50	上海大智慧基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元 法定代表人：申健 联系人：印强明 电话：021-20219988 传真：021-20219988 客户服务电话：021-20292031 网址： <a href="https://www.wg.com.cn">https://www.wg.com.cn</a>
51	北京广源达信基金销售有限公司	注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层 法定代表人：齐剑辉 联系人：王英俊 电话：010-57298634 客服电话：4006236060 传真：010-82055860 网址：www.niuniufund.com
52	上海中正达广基金销售有限公司	注册（办公）地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室 法定代表人：黄欣 联系人：戴珉微 电话：021-33768132 传真：021-33768132-802 客户服务电话：400-6767-523 网址：www.zhongzhengfund.com
53	海银基金销售有限公司	注册（办公）地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元 法定代表人：刘惠 联系人：毛林 电话：021-80133597 传真：021-80133413 客户服务电话：400-808-1016 网址：www.fundhaiyin.com

54	上海万得基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼 法定代表人：王廷富 联系人：姜吉灵 电话：021-5132 7185 传真：021-5071 0161 客户服务电话：400-821-0203
55	深圳前海凯恩斯基金销售有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A 法定代表人：高锋 联系人：廖苑兰 电话：0755-83655588 传真：0755-83655518 客户服务电话：4008048688 网址：www.keynesasset.com
56	中民财富基金销售（上海）	注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元 办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层 法定代表人：弭洪军 联系人：茅旦青 电话：021-33355392 传真：021-63353736 客户服务电话：4008323291 网址：www.cmiwm.com
57	天津国美基金销售有限公司	注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室 办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层 法定代表人：丁东华 联系人：郭宝亮 电话：010-59287984 传真：010-59287825 客户服务电话：4001110889 网址：www.gomefund.com
58	北京蛋卷基金销售有限公司	注册（办公）地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 法定代表人：钟斐斐 联系人：翟相彬 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客户服务电话：400 0618 518

		网址: <a href="http://danjuanapp.com/">http://danjuanapp.com/</a>
59	上海基煜基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济发展区)</p> <p>办公地址: 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室</p> <p>法定代表人: 王翔</p> <p>联系人: 蓝杰</p> <p>电话: 021-65370077</p> <p>传真: 021-55085991</p> <p>客户服务电话: 4008205369</p> <p>网址: <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a></p>
60	上海钜派钰茂基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室</p> <p>办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼 C 座</p> <p>法定代表人: 胡天翔</p> <p>联系人: 卢奕</p> <p>电话: 021-50793059</p> <p>传真: 021-68413161</p> <p>客户服务电话: 4006889967</p> <p>网址: <a href="http://www.jp-fund.com/">http://www.jp-fund.com/</a></p>
61	凤凰金信 (银川) 基金销售有限公司	<p>注册地址: 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402</p> <p>办公地址: 北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼</p> <p>法定代表人: 张旭</p> <p>联系人: 陈旭</p> <p>电话: 010-58160168</p> <p>传真: 010-58160173</p> <p>客户服务电话: 400-810-5919</p> <p>网址: <a href="http://www.fengfd.com">www.fengfd.com</a></p>

62	北京微动利基金销售有限公司	注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室 办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室 法定代表人：梁洪军 联系人：季长军 电话：010-52609551 传真：010-51957430 客户服务电话：400-819-6665 网址：www.buyforyou.com.cn
63	北京格上富信基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 法定代表人：李悦章 联系人：曹庆展 电话：010-65983311 传真：010-65983333 客户服务电话：400-066-8586 网址：www.igesafe.com
64	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06 办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层 法定代表人：陈超 联系人：江卉 电话：4000988511/ 4000888816 传真：010-89188000 客户服务电话：95118 网址：www.fund.jd.com
65	上海朝阳永续基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区上封路 977 号 1 幢 B 座 812 室 法定代表人：廖冰 联系人：陆纪青 电话：15902135304 客户服务电话：4009987172 网址：www.998fund.com

66	泛华普益基金销售有限公司	<p>注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室                  办公地址：四川省成都市锦江区东大街99号平安金融中心1501单元                  法定代表人：于海锋                  联系人：王峰                  电话：028-84252474                  传真：028-84252474                  客户服务电话：4008-588-588                  网址：<a href="https://www.puyifund.com/">https://www.puyifund.com/</a></p>
67	上海华夏财富投资管理有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室                  办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层                  法定代表人：李一梅                  联系人：仲秋玥                  电话：010-88066632                  传真：010-88066214                  客户服务电话：400-817-5666                  网址：<a href="http://www.amcfortune.com">www.amcfortune.com</a></p>
68	上海云湾基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层                  办公地址：上海市浦东新区锦康路308号陆家嘴世纪金融广场6号楼6层                  法定代表人：戴新装                  联系人：朱学勇                  电话：021-20538888                  传真：021-20538999                  客户服务电话：400-820-1515                  网址：<a href="http://www.zhengtongfunds.com">www.zhengtongfunds.com</a></p>
69	上海挖财金融信息服务有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室                  办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室                  法定代表人：胡燕亮                  联系人：义雪辉                  电话：021-50810687                  传真：021-58300279                  客户服务电话：021-50810673                  网址：<a href="http://www.wacaijin.com/">http://www.wacaijin.com/</a></p>



70	深圳秋实惠智基金销售有限公司	注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 办公地址： 北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 2309 法定代表人： 张秋林 联系人： 张秋林 电话： 010-64108876 传真： 010-64108875 客户服务电话： 010-64108876 网址： <a href="http://fund.qiushicaifu.com">http://fund.qiushicaifu.com</a>
71	大河财富基金销售有限公司	注册地址： 贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号 办公地址： 贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号 法定代表人： 王荻 联系人： 方凯鑫 电话： 0851-88405606 传真： 0851-88405599 客户服务电话： 0851-88235678 网址： <a href="http://www.urainf.com">www.urainf.com</a>
72	天津万家财富资产管理有限公司	注册地址： 天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室 办公地址： 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层 法定代表人： 李修辞 联系人： 王芳芳 电话： 010-59013842 传真： 021- 38909635 客户服务电话： 010--59013825 网址： <a href="http://www.wanjiawealth.com">www.wanjiawealth.com</a>
73	北京电盈基金销售有限公司	注册地址： 北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室 办公地址： 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12B 法定代表人： 程刚 联系人： 李丹 电话： 010-56176115 传真： 010-56176117 客户服务电话： 400-100-3391 网址： <a href="http://www.bjdycfund.com">www.bjdycfund.com</a>

74	通华财富（上海）基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼 法定代表人：马刚 联系人：杨徐霆 电话：021-60818249 客户服务电话：95156 网址：www.tonghuafund.com
75	喜鹊财富基金销售有限公司	注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室 办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室 法定代表人：陈皓 联系人：曹砚财 电话：010-58349088 传真：010-88371180 客户服务电话：0891-6177483 网址：www.xiquefund.com
76	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层 法定代表人：杨健 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客户服务电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
77	洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司	注册地址：山东省青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室 办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室 法定代表人：任淑楨 联系人：周映筱 电话：010-66162800 传真：0532-66728591 客户服务电话：4006706863 网址：www.hongtaiwealth.com

78	上海有鱼基金销售有限公司	注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室 办公地址：上海徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层 法定代表人：林琼 联系人：徐海峥 电话：021-60907379 传真：021-60907397 客户服务电话：021-60907378 网址：www.youyufund.com
79	深圳盈信基金销售有限公司	注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1（811-812） 办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1 法定代表人：苗宏升 联系人：王清臣 电话：0411-66889805 传真：0411-66889827 客户服务电话：4007-903-688
80	扬州国信嘉利基金销售有限公司	注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋 办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320 法定代表人：刘晓光 联系人：苏曦 电话：0514-82099618-805 客户服务电话：400-021-6088 网址：https://www.gxjlc.com/

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

## 二、登记机构

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

法定代表人：丁益

电话：0755-82370388-1902

传真：0755-22381325

联系人：曹竞

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：朱宏宇

经办注册会计师：许康玮、朱宏宇

## 第六部分 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，并经中国证监会 2018 年 3 月 27 日证监许可【2018】549 号文准予募集注册。本基金基金合同已于 2018 年 5 月 16 日起正式生效，本基金募集期共募集 547,936,180.96 份，利息结转的份额 147,645.42 份，募集份额合计 548,083,826.38 份，基金管理人的从业人员认购 1,998.25 份。有效认购户数为 13,810 户。

本基金为契约型开放式 ETF 联接基金，基金存续期限为不定期。

### 一、发售时间

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自 2018 年 4 月 16 日至 2018 年 5 月 11 日进行发售。

### 二、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者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。

### 三、发售方式和销售渠道

本基金同时通过直销和其他销售机构代销两种方式公开募集。

本基金通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增减或变更销售机构的相关公告。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得提前发售基金份额。

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按发售面值发售，采用全额缴款的认购方式。投资者在募集期内可以多次认购基金份额，认购申请一经受理不得撤销。

### 四、认购费用

投资者认购需全额缴纳认购费用。认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体认购费率如下表：

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.00%
100 万 ≤ M < 200 万	0.60%
200 万 ≤ M < 500 万	0.30%
M ≥ 500 万	按笔收取, 1000 元/笔

## 五、认购的具体规定

### 1、认购的程序

(1) 申请方式：书面申请或基金管理人公布的其他方式。

(2) 认购款项支付：基金投资者认购时，采用全额缴款方式，若资金未全额到账则认购不成立，基金管理人将认购无效的款项退回。

### 2、认购的确认

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

### 3、认购金额的限制

本基金首次认购最低限额为 1 元，追加认购不受首次认购最低金额的限制（基金管理人直销交易系统及各销售机构可根据业务情况设置高于或等于前述的交易限额，具体以基金管理人及各家销售机构公告为准，投资者在提交基金认购申请时，应遵循基金管理人及各销售机构的相关业务规则）。

募集期间不设置投资者单个账户最高认购金额限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

### 4、认购期利息的处理方式

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

### 5、认购份额的计算

本基金认购份额的计算如下：

当认购费用适用比例费率时：

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

认购份额=（净认购金额+认购期间利息）/基金份额发售面值

当认购费用适用固定金额时：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期间利息）/基金份额发售面值

认购费用、净认购金额以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差由基金财产承担。

例：某投资人投资 10,000 元通过某销售网点认购本基金，对应费率为 1.00%，假设该笔认购产生利息 10 元，则其可得到的认购份额为：

净认购金额=10,000 / (1+1.00%) = 9,900.99 元

认购费用 = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 元

认购份额 = (9,900.99 + 10) / 1.00 = 9,910.99 份

即：投资者投资 10,000 元通过某销售网点认购本基金，假设该笔认购款项在募集期间产生利息 10 元，基金合同生效后，投资者可得到 9,910.99 份基金份额。

六、基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人，同时本基金的目标 ETF 符合备案条件的，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

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

### 三、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2018 年 5 月 16 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 四、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，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；《基金合同》存续期内，如果存在连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人情形，但未出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方



案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决（但基金合同另有约定的除外）；基金合同存续期内，如果存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形，无论是否出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

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、赎回与转换的场所

本基金的申购、赎回与转换将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回与转换，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、赎回与转换时除外。

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

本基金基金合同于 2018 年 5 月 16 日起正式生效。根据《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本公司已于 2018 年 7 月 11 日开始办理本基金的日常申购、赎回和转换业务。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回与转换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、赎回与转换申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销。

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或转换。

5、投资者办理申购、赎回与转换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、赎回与转换的程序

##### 1、申购、赎回与转换的申请方式

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、赎回  
与转换的申请。

##### 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，基金份  
额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回申请成立，基金份额登记机构确认赎回时，赎回生  
效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。  
在发生巨额赎回时或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支  
付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基  
金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后  
的下一个工作日划出。

##### 3、申购、赎回与转换申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购、赎回与转换申请的当天作为申购或赎回  
申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日  
提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的  
其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回与转换申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确  
实接收到该申请。申购、赎回与转换的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回与  
转换申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

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。

#### 五、申购、赎回与转换的数量限制

1、每个账户首次申购的最低金额为 1 元。追加申购不受首次申购最低金额的限制（具体  
以各销售机构或基金管理人公告为准）。投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额

的数量不设上限。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、本基金不设最低赎回份额（其他销售机构另有规定的，从其规定），但某笔赎回导致基金份额持有人持有的基金份额余额不足 1 份时，余额部分基金份额必须一同全部赎回。

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实施前依照《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。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

## 六、申购、赎回与转换费用

1、本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金的申购费率随申购金额的增加而递减，适用以下前端收费费率标准：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.20%
100 万 ≤ M < 200 万	0.80%
200 万 ≤ M < 500 万	0.40%
M ≥ 500 万	按笔收费，1000 元/笔

2、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，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金资产。对于持有期限不少于 7 日（含）的投资者，将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率随持有期限的增加而递减。

持有期限	赎回费率
7 日以内	1.5%
7 日（含）- 1 年	0.50%

1 年（含）—2 年	0.25%
2 年（含）以上	0

注：就赎回费而言，1 年指 365 日，2 年指 730 日

3、基金管理人可以在履行相关手续后，依照法律法规要求，在不损害基金份额持有人利益的前提下，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。

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

## 七、申购、赎回与转换的计算

### 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：

当申购费用适用比例费率时：

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 / T 日基金份额净值

当申购费用适用固定金额时：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

上述金额的计算结果按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，份额的计算结果按尾数舍去的方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差由基金财产承担。

例：某投资者投资 5,000 元申购本基金，申购费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 5,000 / (1 + 1.20%) = 4,940.71 元

申购费用=5,000-4,940.71=59.29 元

申购份额=4,940.71/1.1280=4380.06 份

即：投资者投资 5,000 元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.1280 元，可得到 4380.06 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，基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用，其中：

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

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差由基金财产承担。

例：某投资者持有本基金 10,000 份基金份额 18 个月，赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总额 = 10,000×1.1480 = 11,480.00 元

赎回费用 = 11,480×0.25% = 28.70 元

赎回金额 = 11,480.00-28.70= 11,451.30 元

即：投资者赎回持有期为 18 个月的 10,000 份本基金基金份额，假设赎回当日的基金份额净值为 1.1480 元，可得到 11,451.30 元赎回金额。

## 3、本基金转换交易的计算

本基金的转换交易包括了基金转出和基金转入，其中：

### ①基金转出时赎回费的计算：

由非货币基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）

赎回费用=转出总额×转出基金赎回费率

转出净额=转出总额-赎回费用

### ②基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额=转出净额-申购补差费

其中，申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用-转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】

转入份额=净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

例：投资者申请将持有的本基金基金份额 10,000 份转换为景顺长城公司治理混合型证券投资基金，假设转换当日本基金的基金份额净值为 1.028 元，投资者持有该基金 15 天，对应赎回费均为 0.5%，申购费为 0.8%，公司治理基金的基金份额净值为 1.063 元，申购费为 1.2%，则投资者转换后可得到的公司治理基金份额为：

转出总额=10,000×1.028=10,280 元

赎回费用=10,280×0.5%=51.4 元

转出净额=10,280-51.4= 10,228.6 元

转出净额在转入基金中对应的净申购金额=10,228.6/1.012=10,107.31 元

转出净额在转入基金中对应的申购费用=10,228.6-10,107.31=121.29 元

转出净额在转出基金中对应的净申购金额=10,228.6/1.008=10,147.42 元

转出净额在转出基金中对应的申购费用=10,228.6-10,147.42=81.18 元

净转入金额=10,228.6-MAX【121.29-81.18，0】=10,188.49 元

转入份额=10,188.49/ 1.063=9584.66 份

4、本基金基金份额净值的计算：

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

基金份额净值的计算公式为：T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日基金份额余额总数。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位舍去，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格及采用估值

技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。

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，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

5、本基金的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌。

6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

7、基金管理人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、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

9、法律法规或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1-6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当及时公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格及采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请，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，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

5、本基金的目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌。

6、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

7、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。



## 8、法律法规或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。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。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 暂停赎回：连续 2 个工作日以上(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、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

## 十二、基金转换

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

## 十三、基金份额的转让

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

## 十四、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。

#### 十六、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。

##### （1）适用投资者范围：

本基金的“定期定额投资计划”适用于符合《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金》规定的所有投资者。

##### （2）办理场所：

自 2018 年 7 月 11 日起，投资者可通过本公司直销、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、嘉兴银行股份有限公司、包商银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、恒丰银行股份有限公司、四川天府银行股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、北京增财基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、嘉实财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、上海利得基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、奕丰金融服务（深圳）有限公司、和耕传承基金销售有限公司、深圳市金

斧子基金销售有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、北京广源达信基金销售有限公司、上海中正达广基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、中民财富基金销售（上海）有限公司、天津国美基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海钜派钰茂基金销售有限公司、凤凰金信（银川）投资管理有限公司、北京微动利基金销售有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海朝阳永续基金销售有限公司、泛华普益基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海云湾投资管理有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、深圳秋实惠智基金销售有限公司、大河财富基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、北京电盈基金销售有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、上海有鱼基金销售有限公司、深圳盈信基金销售有限公司和扬州国信嘉利基金销售有限公司办理定期定额业务，具体业务开通情况以各销售机构规定为准，敬请投资者留意各销售机构的相关公告。

#### 十七、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。

#### 十八、基金份额折算

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。

十九、未来，若条件允许，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本基金可申请在交易所上市交易、申购和赎回，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 二、投资范围

本基金以景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（目标 ETF）基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的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%。

#### 1、资产配置策略

本基金主要通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投

资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

## 2、目标 ETF 投资策略

本基金可以通过申购、赎回代理券商申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购、赎回情况，综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定本基金对目标 ETF 的投资方式。通常情况下，本基金以申购、赎回的投资方式为主：当收到净申购申请时，本基金构建股票组合，并且申购目标 ETF；当收到净赎回申请时，本基金赎回目标 ETF，并且卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续申购目标 ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

## 3、股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。

## 4、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

## 5、权证的投资策略

权证为本基金的辅助性投资工作，投资的原则为在严格控制风险的前提下，以有利于提高基金资产的投资效率为目的，通过对权证的基本面进行研究，更好的实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

## 6、资产支持证券的投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还

率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。
- (2) 本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
- (3) 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%。
- (4) 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%。
- (5) 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%。
- (6) 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%。
- (7) 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%。
- (8) 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%。
- (9) 本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。
- (10) 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。
- (11) 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。
- (12) 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。

(13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与投资范围保持一致。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

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第(1)项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，对于除第(1)、(2)、(10)、(14)、(15)项以外的其他情形，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交



易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

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

本基金是 ETF 联接基金，追求对标的指数的有效跟踪，因此采用以标的指数为主要构成部分的业绩比较基准较为合理。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代（其编制方法发生实质性变更的）、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名、标的指数由其他指数替代（其编制方法未发生实质性变更的）等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和对基金合同进行相应修改（包括但不限于基金名称变更），报中国证监会备案并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

## 七、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，（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）。
- 6、中国证监会规定的其他情形。

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

## 八、基金投资组合报告

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至 2018 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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	421,820,000.00	94.18
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,622,705.78	5.27
8	其他资产	2,451,649.00	0.55
9	合计	447,894,354.78	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 4. 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。

## 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

**9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式	景顺长城基金管理有限公司	421,820,000.00	94.77

**10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

**11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

**11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**12. 投资组合报告附注****12.1**

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**12.2**

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。

**12.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	90,291.01
2	应收证券清算款	1,777,986.52
3	应收股利	-
4	应收利息	4,258.09
5	应收申购款	478,406.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	100,707.28
9	合计	2,451,649.00

**12.4 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。

**12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票投资。

**12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

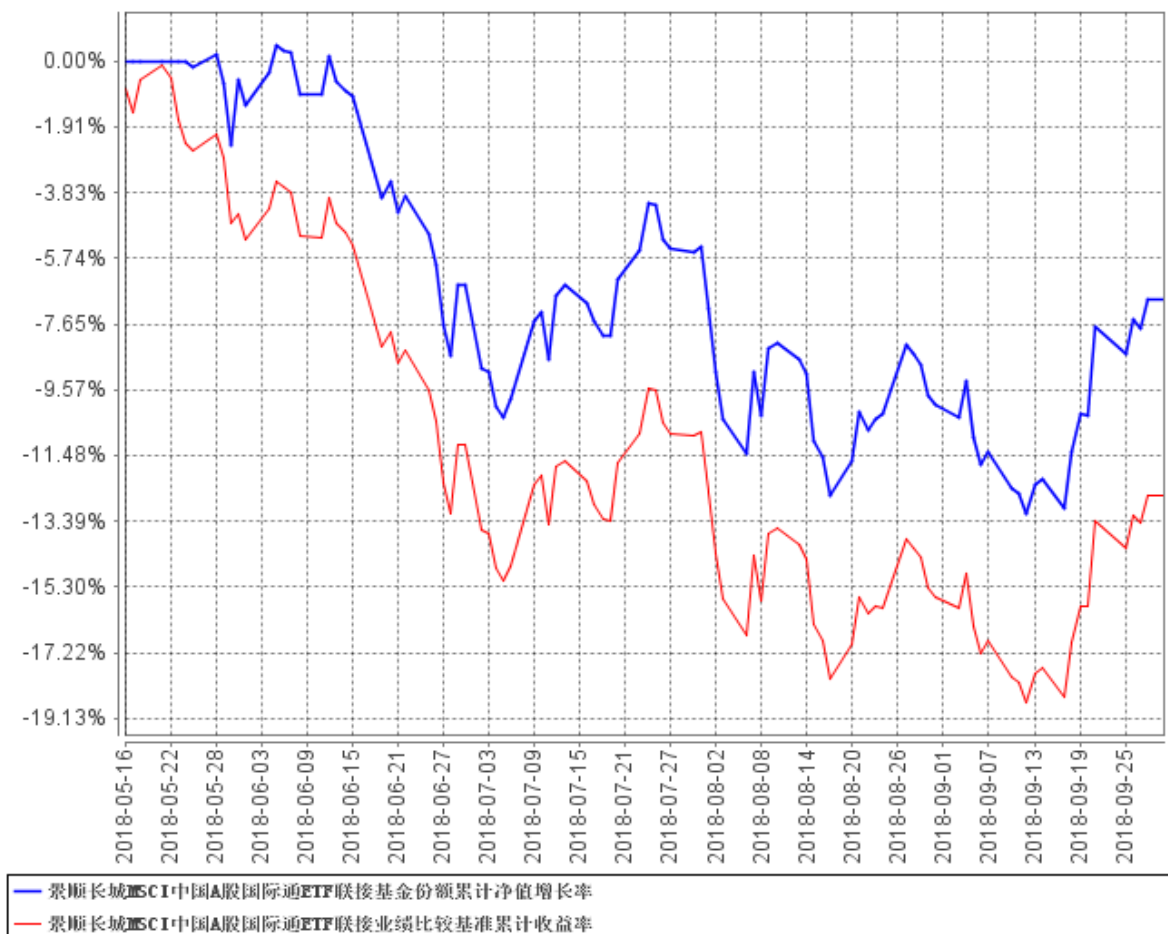
## 第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 9 月 30 日。

### 1. 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2018年5月16日至 2018年9月30日	-6.92%	1.17%	-12.61%	1.23%	5.69%	-0.06%

### 2. 自基金合同生效以来基金份额累计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



注：基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 5 月 16 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2018 年 5 月 16 日）起至本报告期末不满一年。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的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。



## 第十二部分 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

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

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

②在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

③对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

#### (2) 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对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在

市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

④流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

#### （4）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### （5）投资证券衍生品的估值方法

股指期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

（6）本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

（7）估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

（8）同一股票或债券同时在两个或两个以上市场交易的，按股票或债券所处的市场分别估值。

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

#### （10）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。

（11）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。

（12）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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。由此产生的后果由基金管理人承担。

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位舍去。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个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、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。基金管理人每个工作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 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到基金资产净值的 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、前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
- 5、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开放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 11 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。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、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按除权后的基金份额净值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；

2、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；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金

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。

## 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、标的指数许可使用费。
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
- 6、基金份额持有人大会费用。
- 7、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）。
- 8、基金的证券交易费用。
- 9、基金的银行汇划费用。
- 10、账户开户费和账户维护费。
- 11、基金财产投资运营过程中的增值税。
- 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。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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（若为负数，则取 0）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，经基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费



本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。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（若为负数，则取 0）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，经基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—12 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按

照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

需要缴纳增值税的，按照税务机关的要求进行核算，从基金财产中支付，以基金管理人为增值税纳税人进行缴纳。因本基金投资运作产生的其他税收由基金财产承担。国家税收法律、法规另有规定的，从其规定。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 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 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 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。若相关法律法规修订或变更后对于基金信息披露的信息类型、披露内容、披露方式等规定与本部分的内容不同，若适用于本基金，本基金的信息披露按照修订或变更后的法律法规的要求执行。

### 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的指定媒介披露，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：

#### （一）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。

#### （二）基金份额发售公告

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

#### （三）《基金合同》生效公告

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

#### （四）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、基金份额发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。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金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。

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 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百分之五十。
- 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百分之三十。
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁。
- 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百分之零点五。
- 18、基金改聘会计师事务所。
- 19、变更基金销售机构。
- 20、更换基金登记机构。
- 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办理。
- 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、赎回申请后重新接受申购、赎回。
- 26、变更标的指数。
- 27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项。
- 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值。
- 29、中国证监会及基金合同规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）基金投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十一）基金投资证券投资基金的信息披露

基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露投资于其他基金（目标 ETF）的相关情况，包括（1）投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；（2）交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，招募说明书中应当列明计算方法并举例说明；（3）本基金持有的 ETF（目标 ETF）发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。

#### （十二）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媒介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。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### （一）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，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。基金投资于债券与上市公司的股票，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。基金投资于债券和股票，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。

#### （二）流动性风险

##### 1、基金申购、赎回安排

本基金属于开放式基金，一般在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如

果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金财产变现困难，基金面临流动性风险。

## 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资目标 ETF，本基金可以通过申购、赎回代理券商申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购、赎回情况，综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定本基金对目标 ETF 的投资方式。通常情况下，本基金以申购、赎回的投资方式为主：当收到净赎回申请时，本基金赎回目标 ETF，并且卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续申购目标 ETF 的基础证券或者择机在二级市场卖出。故，投资组合整体的流动性风险较低。但不排除由于市场波动或者所持证券发行人出现异常情况导致组合流动性降低的情形。为了防止此类风险，本基金管理人制定了适用于开放式和定期开放式基金的流动性风险管理办法并对该管理办法的有效性和执行情况进行定期回购。

## 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理测试

本基金管理人构建了压力测试模型用于每日监测基金的各项风险以及不同市场环境下可应付的最大赎回。在发生巨额赎回情况时，本基金管理人根据当时市场状况并辅以压力测试模型等流动性分析工具及时制定投资组合变现计划以确保在尽可能地保护投资者权益的前提下满足赎回需求。

## 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响等

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，依照法律法规还可以使用的备用流动性风险管理工具包括：延期办理巨额赎回申请或延缓支付赎回款项、暂停接受赎回申请、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等。实施这些备用工具前要经过公司管理层批准、与基金管理人协商确认后由法律监察稽核部对外披露。实施这些备用工具对投资者的潜在影响包括：（一）可能导致部分持有人无法及时获得现金；（二）如果基金所持资产的市场价格下跌，则导致基金净值下跌从而持有人财产发生损失。

### （三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （四）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在基金的后台运作中，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甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所等。

### （六）合规性风险

基金管理或运作过程中，违反国家法律法规或基金合同有关规定的风险。

### （七）本基金特有的风险

基于投资范围的规定，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，无法规避股票市场的投资风险，尤其是系统性风险。

#### 1、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。

#### 2、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。

### 3、投资于目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金，大部分资产投资于目标 ETF，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。同时，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。

目标 ETF 的标的指数发生变更，如本基金不变更目标 ETF 的，本基金有业绩比较基准随之变更的风险。

4、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，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(2) 申购/赎回的影响，目标 ETF 采取实物申购/赎回的方式，申购/赎回对基金净值影响较小；而本基金申购/赎回采取现金方式，不仅大额申购/赎回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购/赎回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。

5、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

### (八) 提前终止风险

如果存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形，无论是否出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会；因此，本基金存在提前终止的风险。

### (九) 税负增加风险

财政部、国家税务总局财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理

人为增值税纳税人。”鉴于基金合同中管理人的管理费中不包括产品运营过程中发生的税款，本基金运营过程中需要缴纳增值税应税的，将由基金份额持有人承担并从基金资产中支付，按照税务机关的规定以基金管理人为增值税纳税人履行纳税义务，因此可能增加基金份额持有人的投资税费成本。

#### （十）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统出现问题产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展但在人员配备、内控等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产损失并影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 二、声明

本基金并非由MSCI公司（“MSCI”）、其任何附属企业、其任何信息提供者或涉及或关于汇编、计算或创设任何MSCI指数的任何其他第三方（合称“MSCI当事方”）赞助、支持、销售或推广。MSCI指数是MSCI的独占性财产。MSCI和MSCI指数名称是MSCI或其附属企业的服务标识，而被许可方经许可可为特定目的使用。任何MSCI当事方均未向本基金的发行方、所有者、或任何其他个人或实体就关于向基金的总体投资或投资于这一特定基金的可取性，或任何MSCI指数追踪相应股票市场表现的能力，作出过任何明示或暗示的陈述或保证。MSCI或其附属企业是特定商标、服务标识以及商号的许可方，以及MSCI指数的许可方，MSCI指数是由MSCI确定、建构并计算的，而未涉及本基金或本基金的发行方或所有者或任何其他个人或实体。任何MSCI当事方均无义务在确定、合成并计算MSCI指数时考虑本基金的发行方或所有者或任何其他个人或实体的需要。任何MSCI当事方均不负责亦未曾参与对将发行的本基金的发行时间、价格或数量的确定，亦未参与本基金赎回的公式或对价的确定或计算。另外，任何MSCI当事方均不对本基金的发行方或所有者或任何其他个人或实体就本基金的管理、营销或销售承担任何义务或责任。

虽然MSCI应从MSCI认为可靠的来源获得包括于或使用于MSCI指数计算的信息，任何MSCI当事方均未就任何MSCI指数或其中包括的任何数据的原创性、准确性和/或完整性作出保证

或担保。任何 MSCI 当事方均未就本基金的发行方、本基金的所有者或任何其他个人或实体因使用任何 MSCI 指数或其中包括的任何数据而得到的结果作出任何明示或暗示的保证。任何 MSCI 当事方均不应就任何 MSCI 指数或其中包括的任何数据中的或与之有关的任何错误、疏漏或中断承担任何责任。另外，任何 MSCI 当事方均未就每一 MSCI 指数和其中包括的任何数据的商用性以及适合某一特定目的作出任何种类的任何明示或暗示的保证，且 MSCI 当事方在此明确否认作出就此有关的任何保证。在不损害前述任何规定的情况下，MSCI 当事方在任何情况下都不应就任何直接的、间接的、特殊的、惩罚性的、后果性的或任何其他损害（包括利润损失）承担任何责任，即使该等损害的可能性已被告知。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定的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表决通过之日起生效，生效后方可执行，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、基金合同存续期内，如果存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形，无论是否出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### 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) 对基金剩余财产进行分配。

#### 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。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利、义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法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、法规规定，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、法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；
- (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、转换和非交易过户等的业务规则；
- (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) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合

理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利、义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户和证券账户等投资所需账户、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等投资所需账户，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；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利、义务

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

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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做

出投资决策，自行承担投资风险；

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

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，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 基金份额持有人大会。

### （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，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》;
- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,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;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- (12) 对基金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) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式;
- (3) 增加、减少、调整基金份额类别设置;
- (4) 调整基金份额净值的计算和公告时间或频率。
- (5) 本基金采取其他方式参与目标 ETF 的申购赎回。
- (6) 在条件允许的情况下,安排基金份额的上市交易。
- (7) 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、非交易过户、转托管等业务的规则。
- (8) 基金推出新业务或服务。
- (9) 由于目标 ETF 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：

(10) 由于目标 ETF 的标的指数发生变更，本基金不变更目标 ETF，则本基金的标的指数将随之变更，并相应变更业绩基准和基金名称；

(11) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

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

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

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

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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、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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式或法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并

且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知载明的形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址或系统。

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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

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

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见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直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人大会可通过网络、电话等非现场方式召开，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方

式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，且除书面授权外，基金份额持有人之间的授权亦可根据召集人在会议通知中规定的方式，通过电话、网络等方式进行。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资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，但应当计入出具表决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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人、基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定的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表决通过之日起生效，生效后方可执行，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、基金合同存续期内，如果存在连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元情形，无论是否出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人情形的，基金管理人应当终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### （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）对基金剩余财产进行分配。

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。

### 四、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。



## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：景顺长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

邮政编码：518048

法定代表人：丁益

成立日期：2003 年 6 月 12 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] 76 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.3 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### (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：周慕冰

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；代理收付款项及代理保险业务；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；外汇票据承兑和贴现；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。

## 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。

本基金的投资范围为：本基金以景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（目标 ETF）基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的配置比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

(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) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

(2) 本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中

现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

(3) 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%。

(4) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。

(5) 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%。

(6) 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%。

(7) 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%。

(8) 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%。

(9) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

(10) 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。

(11) 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。

(12) 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。

(13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与投资范围保持一致。

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

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第(1)项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，对于除第(1)、(2)、(10)、(14)、(15)项以外的其他情形，基金管理人应当在 10 个交易日

内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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。在上述期间内，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另有规定的，从其规定。

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

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。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人并有权向中国证监会报告。

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

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易

前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

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

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

1、基金投资流通受限证券，应遵守《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流通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流通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。

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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。

（九）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。

(十) 基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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、基金管理人有关基金托管人的业务核查

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

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

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

### 四、基金财产的保管

#### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

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

### （二）基金募集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托管资金账户，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、基金托管人应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、基金托管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、基金托管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）申购或赎回时非担保交收资金的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的结算通知和基金管理人的指令办理本基金因申购、赎回产生的非担保交收资金的结算。

#### （六）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，以基金的名义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。

#### （七）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。

#### （八）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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担

保管责任。

#### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

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。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、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净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

### 六、基金份额持有人名册的保管

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。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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、托管协议的变更与终止

### （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备案。

### （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、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

## 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，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改以下服务项目：

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、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交易记录。

2、本公司按照投资者成功定制的服务形式提供基金对账单服务，对于未定制账单服务的投资者不主动提供对账单。

(1) 月度电子邮件对账单：每月初 5 个工作日内，本公司以电子邮件方式给截至上月最后一个交易日仍持有本公司基金份额或者账户余额为 0 但当期有交易发生的定制投资者发送月度电子邮件对账单。

(2) 月度短信对账单：每月初 5 个工作日内，本公司以短信方式给截至上月最后一个交易日仍持有本公司基金份额的定制投资者发送月度短信对账单。

(3) 月度微信对账单：每月初 5 个工作日内，本公司以微信方式给截至上月最后一个交易日仍持有本公司基金份额或者账户余额为 0 但当期有交易发生、且已在“景顺长城基金”微信公众号上成功绑定账户的投资者发送月度微信对账单。

(4) 季度及年度纸质对账单：每年一、二、三季度结束后，本公司向定制纸质对账单且在当季度内有交易的投资者寄送季度对账单；每年度结束后，本公司向定制纸质对账单且在第四季度内有基金交易或者年度最后一个交易日仍持有本公司基金份额的投资者寄送年度纸质对账单。

因提供的个人信息（包括但不限于姓名、电子邮件地址、邮寄地址、邮编等）不详、错误、变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的，请及时到原基金销售网点或本公司网站办理联系方式变更手续。详询 400-8888-606，或通过本公司网站（[www.igwfmc.com](http://www.igwfmc.com)）“在线客服”咨询。

### 二、网络在线服务

基金管理人利用其网站(www.igwfm.com)定期或不定期为投资者提供基金管理人信息、基金产品信息、账户查询、投资策略分析报告、热点问答等服务。投资者可以登陆该网站修改基金查询密码。

对于直销个人客户,基金管理人同时提供网上交易服务。

### 三、客户服务中心(Call Center)电话服务

投资者想要了解交易情况、基金账户余额、基金产品与服务信息或进行投诉等,可拨打基金管理人客户服务电话:400 8888 606(免长途费)。

客户服务中心的人工坐席服务时间为每周一至周五(法定节假日及因此导致的证券交易所休市日除外)9:00—17:00。

### 四、客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金管理人网站留言栏目、自动语音留言栏目、客户服务中心人工热线、书信、电子邮件等六种不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

基金管理人承诺在工作日收到的投诉,将在下一个工作日内作出回应,在非工作日收到的投诉,将顺延至下一个工作日当日或者次日回复。对于不能及时解决的投诉,基金管理人就投诉处理进度向投诉人作出定期更新。

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

## 第二十二部分 其他应披露事项

2018 年 10 月 29 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京蛋卷基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告》

2018 年 10 月 26 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年第 3 季度报告》

2018 年 9 月 29 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告》

2018 年 7 月 20 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加奕丰金融服务（深圳）有限公司基金转换费率优惠活动的公告》

2018 年 7 月 20 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加奕丰金融服务（深圳）有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告》

2018 年 7 月 10 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金在直销网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告》

2018 年 7 月 9 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》

2018 年 7 月 9 日发布《关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金参加部分销售机构申购及/或定期定额投资申购费率优惠活动的公告》

2018 年 6 月 30 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》

2018 年 5 月 23 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增四川天府银行股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告》

2018 年 5 月 17 日发布《关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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》

2018 年 4 月 27 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务》

2018 年 4 月 25 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增扬州国信嘉利基金销售有限公司为销售机构的

公告》

2018 年 4 月 24 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增中国民生银行股份有限公司和广发银行股份有限公司为销售机构的公告》

2018 年 4 月 23 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海钜派钰茂基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告》

2018 年 4 月 20 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增嘉兴银行股份有限公司为销售机构的公告》

2018 年 4 月 14 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金在直销网上交易系统部分渠道实施认购费率优惠活动的公告》

2018 年 4 月 14 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金参加部分代销机构认购费率优惠活动的公告》

2018 年 4 月 12 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

2018 年 4 月 12 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通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》

2018 年 4 月 12 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》

2018 年 4 月 12 日发布《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及《摘要》

### 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

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。投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买基金招募说明书复印件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 第二十四部分 备查文件

（一）中国证监会准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集注册的文件

（二）景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同

（三）法律意见书

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

（七）中国证监会要求的其他文件

上述文件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。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一八年十二月二十八日