



交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（更新）招募说明书摘要

（2020 年第 1 号）

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二〇年四月

【重要提示】

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2015 年 5 月 20 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2015】941 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2015 年 6 月 26 日正式生效。

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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前，需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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；流动性风险；交易对手违约风险；投资股指期货的特定风险；投资科创板股票的特定风险；投资本基金特有的风险等等。投资本基金特有的风险主要包括指数化投资风险和基金运作的特有风险。其中指数化投资风险主要包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险等；基金运作的特有风险主要包括：上市交易风险、杠杆机制风险、基金份额的折/溢价交易风险、基金份额风险收益特征变化风险、基金份额折算风险、份额配对转换业务中存在的风险、基金不进行收益分配、极端情形下的损失风险、交银互联网金融 A 份额约定年基准收益率调整带来的再投资风险、交银互联网金

融 A 份额约定年基准收益率上调带来的剩余资产分配减少的风险、基金份额参考净值不代表基金份额持有人可获得的实际价值等。

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并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。

本摘要根据基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、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。

本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 4 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 3 月 31 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

邮政编码：200120

法定代表人：阮红

成立时间：2005 年 8 月 4 日

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：郭佳敏

电话：(021) 61055050

传真：(021) 61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司（以下使用全称或其简称“交通银行”）	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	5%

(二) 主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

阮红女士，董事长，博士。历任交通银行办公室副处长、处长，交通银行海外机构管理部副总经理、总经理，交通银行上海分行副行长，交通银行资产托管部总经理，交通银行投资管理部总经理，交银施罗德基金管理有限公司总经理。

陈朝灯先生，副董事长，博士。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理，景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。

周曦女士，董事，硕士。现任交通银行总行个人金融业务部副总经理兼风险管理部（资产保全部）副总经理。历任交通银行湖南省分行风险管理部、资产保

全部、法律合规部、个人金融业务部总经理，交通银行总行个人金融业务部总经理助理。

孙荣俊先生，董事，硕士。现任交通银行总行风险管理部（资产保全部）副总经理。历任交通银行总行风险管理部副高级经理、高级经理，交通银行广西区柳州分行副行长，交通银行内蒙古区分行行长助理。

谢卫先生，董事，总经理，博士，高级经济师，民盟中央委员、全国政协委员。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理，兼任交银施罗德资产管理(香港)有限公司董事长。历任中央财经大学教师，中国社会科学院财贸所助理研究员，中国电力信托投资公司基金部副总经理，中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理，北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理，富国基金管理有限公司副总经理，交银施罗德基金管理有限公司副总经理。

李定邦（Lieven Debruyne）先生，董事，硕士。现任施罗德集团全球业务总裁、亚太区行政总裁，担任集团管理委员会成员。历任施罗德投资管理有限公司亚洲投资产品总监，施罗德投资管理（香港）有限公司行政总裁兼亚太区基金业务拓展总监。

郝爱群女士，独立董事，学士。历任人民银行稽核司副处长、处长，合作司调研员，非银司副巡视员、副司长，银监会非银部副主任，银行监管一部副主任、巡视员，汇金公司派出董事。

张子学先生，独立董事，博士。现任中国政法大学民商经济法学院教授，兼任基金业协会自律监察委员会委员。历任证监会办公厅副处长、上市公司监管部处长、行政处罚委员会专职委员、副主任审理员，兼任证监会上市公司并购重组审核委员会委员、行政复议委员会委员。

黎建强先生，独立董事，博士，教育部长江学者讲座教授。现任香港大学工业工程系荣誉教授，亚洲风险及危机管理协会主席，兼任深交所上市的中联重科集团独立非执行董事。历任香港城市大学管理科学讲座教授，湖南省政协委员并兼任湖南大学工商管理学院院长。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生，监事长，硕士。现任交银金融学院常务副院长，交通银行人力资源部副总经理、教育培训部总经理。历任交通银行办公室副处长，交通银行公

司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理，交通银行投资银行部副总经理，交通银行江苏分行副行长，交通银行战略投资部总经理。

章骏翔先生，监事，硕士，志奋领学者，美国特许金融分析师(CFA)持证人。现任施罗德投资管理(香港)有限公司亚洲投资风险主管。历任法国安盛投资管理(香港)有限公司亚洲风险经理，华宝兴业基金管理有限公司风险管理部总经理，渣打银行(香港)交易风险监控等职。

刘峥先生，监事，硕士。现任交银施罗德基金管理有限公司综合管理部副总经理。历任交通银行上海市分行管理培训生，交通银行总行战略投资部高级投资并购经理，交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室高级综合管理经理。

黄伟峰先生，监事，硕士。现任机构理财部(上海)总经理兼产品开发部总经理。历任平安人寿保险公司上海分公司行政督导、营销管理经理，交银施罗德基金管理有限公司行政部总经理助理、西部营销中心总经理。

3、基金管理人高级管理人员

谢卫先生，总经理。简历同上。

夏华龙先生，副总经理、首席信息官，博士，高级经济师。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长；交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理；交通银行资产托管业务中心副总裁；云南省曲靖市市委常委、副市长(挂职)。

印皓女士，副总经理，硕士，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行研究开发部主管体改规划员，交通银行市场营销部主管市场规划员、主管市场规划员，交通银行公司业务部副高级经理、高级经理，交通银行机构业务部高级经理、总经理助理、副总经理。

许珊燕女士，副总经理，硕士，高级经济师，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师，湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理，湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

余川女士，督察长，硕士。历任华泰证券有限责任公司综合发展部高级经理、投资银行部项目经理，银河基金管理有限公司监察部总监，交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理、监察风控副总监、投资运营总监。

4、本基金基金经理

蔡铮先生，基金经理。复旦大学电子工程硕士。11 年证券从业经验。2007 年 7 月起在瑞士银行香港分行工作。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任投资研究部数量分析师、量化投资部助理总经理、量化投资部副总经理，现任量化投资副总监兼多元资产管理副总监。2011 年 3 月 7 日至 2012 年 12 月 26 日担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2011 年 9 月 22 日至 2012 年 12 月 26 日担任深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，2011 年 9 月 28 日至 2012 年 12 月 26 日担任交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2012 年 11 月 7 日至 2012 年 12 月 26 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理助理，2012 年 12 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理，2015 年 4 月 22 日至 2017 年 3 月 24 日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理、交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。2012 年 12 月 27 日起担任上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理至今，2015 年 3 月 26 日起担任交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金经理至今，2015 年 5 月 27 日起担任交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理至今，2015 年 6 月 26 日起担任交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理至今，2016 年 7 月 19 日起担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理至今，2018 年 5 月 18 日起担任交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金基金经理至今，2019 年 11 月 20 日起担任交银施罗德创业板 50 指数型证券投资基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员：谢卫（总经理）

王少成（权益投资总监、基金经理）

于海颖（固定收益（公募）投资总监、基金经理）

马俊 (研究总监)

上述人员之间不存在近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为 2020 年 4 月 23 日, 期后变动 (如有) 敬请关注基金管理人发布的相关公告。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行)

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 田国立

成立时间: 2004 年 09 月 17 日

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人: 田 青

联系电话: (010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月, 是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行, 总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939), 于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末, 集团资产规模 23.22 万亿元, 较上年增长 4.96%。2018 年度, 集团实现净利润 2,556.26 亿元, 较上年增长 4.93%; 平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%; 不良贷款率 1.46%, 保持稳中有降; 资本充足率 17.19%, 保持领先同业。

2018 年, 本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”; 美国《环球金融》“全球贸易金融

最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖”年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管

人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末,中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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;业务管理严格实行复核、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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2) 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上直销交易平台（网站及手机 APP，下同）。

机构名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

法定代表人：阮红

成立时间：2005 年 8 月 4 日

电话：(021) 61055724

传真：(021) 61055054

联系人：傅鲸

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），(021) 61055000

网址：www.fund001.com

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的场外申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。

网上直销交易平台网址：www.fund001.com。

2、场内销售机构

具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所场内会员单位（具体名单见深圳证券交易所网站）。

3、除基金管理人之外的其他场外销售机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

电话：(010) 66275654

传真: (010) 66275654

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

(2) 交通银行股份有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 彭纯

电话: (021) 58781234

传真: (021) 58408483

联系人: 曹榕

客户服务电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(3) 招商银行股份有限公司

住所: 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 李建红

电话: (0755) 83198888

传真: (0755) 83195109

联系人: 邓炯鹏

客户服务电话: 95555

网址: www.cmbchina.com

(4) 上海银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路 168 号

办公地址: 上海市银城中路 168 号

法定代表人: 金煜

电话: (021) 68475888

传真: (021) 68476111

联系人: 张萍

客户服务电话: (021) 962888

网址: www.bankofshanghai.com

(5) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所: 江苏省常州市和平中路 413 号

办公地址: 江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人: 陆向阳

电话: 0519-80585939

传真: 0519-89995170

联系人: 蒋姣

客户服务电话: 96005

网址: <http://www.jnbank.com.cn>

(6) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所: 东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址: 东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人: 王耀球

电话: (0769) 22866254

传真: (0769) 22866282

联系人: 林培珊

客户服务电话: (0769) 961122

网址: www.drcbank.com

(7) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

电话: (021) 22169999

传真: (021) 22169134

联系人: 刘晨

客户服务电话: 10108998

网址: www.ebscn.com

(8) 平安证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼 (518048)

法定代表人: 杨宇翔

电话: (0755) 22627802

传真: (0755) 82400862

联系人: 郑舒丽

客户服务电话: 95511-8

网址: www.pingan.com

(9) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

电话: (010) 85130588

传真: (010) 65182261

联系人: 魏明

客户服务电话: 95587

网址: www.csc108.com

(10) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈共炎

电话: 010-83574507

联系人: 辛国政

客户服务电话: 400-888-8888

网址: www.chinastock.com.cn

(11) 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人: 杨华辉

电话: 021-38565547

联系人: 乔琳雪

网址: www.xyzq.com.cn

客户服务电话: 95562

(12) 中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

电话: 010-60838888

客服电话: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

(13) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人: 杨玉成

电话: (021) 33389888

联系人: 李清怡

客户服务电话: 95523/400-800-0562

网址: www.sywg.com

(14) 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 王少华

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(15) 中信证券 (山东) 有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址: 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人: 姜晓林

电话: 0531-89606166

传真: 0532-85022605

联系人: 焦刚

客户服务电话: 95548

网址: sd.citics.com

(16) 安信证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 王连志

电话: (0755) 82558305

传真: (0755) 82558355

联系人: 陈剑虹

客户服务电话: 400-800-1001

网址: www.essence.com.cn

(17) 申万宏源西部证券有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券

法定代表人: 冯戎

电话: (010) 88085858

传真: (010) 88085195

联系人: 李巍

客户服务电话: 4008-000-562

网址: www.hysec.com

(18) 中泰证券股份有限公司

住所: 山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李玮

电话: (0531) 68889155

传真: (0531) 68889752

联系人: 许曼华

客户服务电话: 95538

网址: www.zts.com.cn

(19) 江海证券有限公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

电话: (0451) 85863719

传真: (0451) 82287211

联系人: 刘爽

客户服务电话: 400-666-2288

网址: www.jhzq.com.cn

(20) 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人: 毕明建

电话: (010) 65051166

传真: (010) 85679203

联系人: 杨涵宇

网址: www.cicc.com.cn

(21) 国金证券股份有限公司

住所: 四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址: 成都市东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

电话: (028) 86690057, (028) 86690058

传真: (028) 86690126

联系人: 刘婧漪 贾鹏

客户服务电话: 95310

网址: www.gjzq.com.cn

(22) 信达证券股份有限公司

住所: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人: 张志刚

电话: (010) 63081000

传真: (010) 63081344

联系人: 尹旭航

客户服务电话: 95321

网址: www.cindasc.com

(23) 西南证券股份有限公司

住所: 重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人: 吴坚

电话: (023) 63786141

传真: (023) 63786212

联系人: 张煜

客户服务电话: 95355、400-809-6096

网址: www.swsc.com.cn

(24) 中国中金财富证券有限公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层
及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21
层

法定代表人: 高涛

电话: (0755) 88320851

联系人: 胡芷境

客户服务电话: 95532/400-600-8008

网址: www.ciccwm.com

(25) 华融证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 宋德清

电话: (010) 58568235

传真: (010) 58568062

联系人: 黄恒

客户服务电话: (010) 58568118

网址: www.hrsec.com.cn

(26) 天相投资顾问有限公司

住所: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人: 林义相

电话: (010) 66045529

传真: (010) 66045518

联系人: 尹伶

客户服务电话: (010) 66045678

网址: <http://www.txsec.com>, www.jjm.com.cn

(27) 中信期货有限公司

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

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

法定代表人: 张皓

电话: 010-60833754

传真: 021-60819988

联系人: 刘宏莹

客服电话: 400-990-8826

网站: www.citicsf.com

(28) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

电话: (0571) 28829790, (021) 60897869

传真: (0571) 26698533

联系人: 周熾旻

客户服务电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

(29) 深圳众禄基金销售有限公司

住所: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

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

电话: (0755) 33227953

传真: (0755) 33227951

联系人: 汤素娅

客户服务电话: 4006-788-887

网址: www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(30) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

电话: (021) 20691832

传真: (021) 20691861

联系人: 单丙烨

客户服务电话: 400-820-2899

网址: www.erichfund.com

(31) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 2 楼

法定代表人: 汪静波

电话: (021) 38600735

传真: (021) 38509777

联系人: 方成

客户服务电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(32) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

电话: (021) 20835789

传真: (021) 20835879

联系人: 周轶

客户服务电话: 4009200022

网址: <http://licaike.hexun.com/>

(33) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

法定代表人: 其实

电话: (021) 54509998

传真: (021) 64385308

联系人: 潘世友

客户服务电话: 400-1818-188

网址: www.1234567.com.cn

(34) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区丹棱街 6 幢 1 号 9 层 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 幢 1 号 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

电话: (010) 57418829

传真: (010) 57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

(35) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：陈操

电话：(010) 58325395

传真：(010) 58325282

联系人：刘宝文

客户服务电话：400-850-7771

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

(36) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：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 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：(010) 59601366-7024

传真：(010) 62020355

联系人：马林

客户服务电话：400-888-6661

网址：www.myfund.com

(37) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：010-88312877

传真：010-88312099

联系人：苏昊

客户服务电话：400-001-1566

网址: <http://www.yilucaifu.com/>

(38) 上海联泰资产管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人: 燕斌

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

联系人: 凌秋艳

客户服务电话: 4000-466-788

网址: www.66zichan.com

(39) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人: 凌顺平

电话: (0571) 88911818

传真: (0571) 86800423

联系人: 吴强

客户服务电话: 400-877-3772

网址: www.5ifund.com

(40) 上海基煜基金销售有限公司

住所: 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)

办公地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人: 王翔

电话: (021) 35385521

传真: (021) 55085991

联系人: 蓝杰

客户服务电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

(41) 珠海盈米财富管理有限公司

住所: 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

电话: (020) 89629099

传真: (020) 89629011

联系人: 黄敏嫦

客户服务电话: (020) 89629066

网址: www.yingmi.cn

(42) 上海陆金所资产管理有限公司

住所: 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 14 楼

法定代表人: 郭坚

电话: (021) 20665952

传真: (021) 22066653

联系人: 宁博宇

客户服务电话: 4008219031

网址: www.lufunds.com

(43) 北京虹点基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人: 胡伟

电话: (010) 65951887

传真: (010) 65951887

联系人: 姜颖

客户服务电话: 400-618-0707

网址: www.hongdianfund.com/

(44) 上海凯石财富基金销售有限公司

住所: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址: 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人: 陈继武

电话: 021-63333319

传真: 021-63332523

联系人: 李晓明

客服电话: 4000 178 000

网址: www.lingxianfund.com

(45) 上海利得基金销售有限公司

住所: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

电话: 021-50583533

传真: 021-50583633

联系人: 徐鹏

客服电话: 400-005-6355

网址: a.leadfund.com.cn

(46) 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人: 杨文斌

传真: (021) 68596916

联系人: 薛年

客户服务电话: 400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

(47) 北京汇成基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

电话: (010) 56282140

传真: (010) 62680827

联系人: 丁向坤

客户服务电话: 400-619-9059

网址: www.fundzone.cn、www.51jijinhui.com

(48) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所: 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: 李悦

电话: (010) 56642600

传真: (010) 56642623

联系人: 张晔

客户服务电话: 4007868868

网址: www.chtfund.com

(49) 奕丰基金销售有限公司

住所: 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: TEO WEE HOWE

电话: (0755) 89460500

传真: (0755) 21674453

联系人: 叶健

客户服务电话: 400-684-0500

网址: www.ifastps.com.cn

(50) 北京创金启富投资管理有限公司

住所: 北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室

法定代表人: 梁蓉

电话: (010) 66154828

传真: (010) 63583991

联系人: 李婷婷

客户服务电话: 400-6262-818

网址: www.5irich.com

(51) 日发资产管理(上海)有限公司

住所: 上海市陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行大厦 3301 室

办公地址: 上海市陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行大厦 3301 室

法定代表人: 周泉恭

电话: (021) 61600500

传真: (021) 61600602

联系人: 蔡小威

客户服务电话: 400-021-1010, (021) 61600500

网址: www.rffund.com

(52) 上海云湾投资管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层, 200127

办公地址: 上海市锦康路 308 号 6 号楼 6 层

法定代表人: 戴新装

电话: (021) 20538888

传真: (021) 20538999

联系人: 江辉

客户服务电话: 400-820-1515

网址: www.zhengtongfunds.com

(53) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所: 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一号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人: 钱昊旻

电话: (010) 59336533

传真: (010) 59336500

联系人: 孟汉霄

客户服务电话: 4008-909-998

网址: www.jnlc.com

(54) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人: 李昭琛

电话: (010) 60619607

传真: 8610-62676582

联系人: 付文红

客户服务电话: (010) 62675369

网址: www.xincail.com

(55) 北京肯特瑞基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人: 王苏宁

电话: 95118

传真: 010-89189566

联系人: 李丹

客服热线: 95118

网址: kenterui.jd.com

(56) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司

住所: 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(750000)

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 (100000)

法定代表人: 程刚

电话: (010) 58160168

传真: (010) 58160173

联系人: 张旭

客户服务电话: 400-810-5919

网址: www.fengfd.com

(57) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址: 北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人: 钟斐斐

电话: (010) 61840688

传真: (010) 84997571

联系人: 侯芳芳

客户服务电话: 400-1599-288

网址: danjuanapp.com

(58) 深圳市金斧子基金销售有限公司

住所: 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人: 赖任军

电话: (0755) 66892301

传真: (0755) 66892399

联系人: 张烨

客户服务电话: 400-9500-888

网址: www.jfzinv.com

(59) 格上富信投资顾问有限公司

住所: 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

电话: (010) 85594745

传真: (010) 65983333

联系人: 张林

客户服务电话: 400-066-8586

网址: www.igesafe.com

(60) 上海万得基金销售有限公司

住所: 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 9 楼

法定代表人: 王廷富

电话: 021-50712782

传真: 021-50710161

联系人: 徐亚丹

客户服务电话: 400-821-0203

网址: www.520fund.com.cn

(61) 天津万家财富资产管理有限公司

住所: 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

电话: (010) 59013828

传真: (010) 59013707

联系人: 王芳芳

客户服务电话: 010-59013842

网址: <http://www.wanjiawealth.com/>

(62) 上海挖财金融信息服务有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 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 层 01、02、03 室

法定代表人: 胡燕亮

电话: (021) 50810687

传真: (021) 58300279

联系人: 李娟

客户服务电话: (021) 50810673

网址: www.wacaijijin.com

(63) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

住所: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

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

法定代表人: 沈伟桦

电话: 010-52855713

传真: 010-85894285

联系人: 程刚

客户服务电话: 400-6099-200

网址: www.yixinfund.com

(64) 嘉实财富管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

电话: (021) 38789658

传真: (021) 68880023

联系人: 王宫

客户服务电话: 400-021-8850

网址: www.harvestwm.cn

(65) 南京苏宁基金销售有限公司

住所: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 王锋

电话: 025-66996699

传真: 025-66996699

联系人: 冯鹏鹏

客户服务电话: 95177

网址: www.snjijin.com

(66) 北京百度百盈基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址: 北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法定代表人: 张旭阳

电话: 010-61952703

传真: 010-61951007

联系人: 霍博华

客户服务电话: 95599-9

网址: www.baiyingfund.com

(67) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人: 张冠宇

电话: (010) 85870662

传真: (010) 59200800

联系人: 刘美薇

客户服务电话: 400-819-9868

网址: www.tdyhfund.com

(68) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 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: 毛淮平

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

联系人: 张静怡

客户服务电话: 400-817-5666

网址: www.amcfortune.com

(69) 江苏汇林保大基金销售有限公司

住所: 南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址: 江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人: 吴言林

电话: 025-66046166 转 837

传真: 025-56663409

联系人: 孙平

客户服务电话: 025-66046166

网址: www.huilinbd.com

(70) 上海大智慧基金销售有限公司

住所: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人: 申健

电话: 021-0219988-35374

传真: 021-20219923

联系人: 张蜓

客户服务电话: 021-20292031

网址: <https://www.wg.com.cn>

(71) 玄元保险代理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人: 马永谱

电话: (021) 50701053

传真: (021) 50701053

客户服务电话: 400-080-8208

网址: www.licaimofang.cn

(72) 阳光人寿保险股份有限公司

住所: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人: 李科

电话: (010) 85632771

传真: (010) 85632773

联系人: 王超

客户服务电话: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com>

(73) 大连网金基金销售有限公司

住所: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人: 樊怀东

电话: (0411-39027810)

传真: (0411-39027835)

联系人: 于秀

客户服务电话: 4000-899-100

网址: <http://www.yibaijin.com>

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构销售本基金, 并在管理人网站公示。

(二) 登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 周明

电话: (010) 50938782

传真: (010) 50938907

联系人: 赵亦清

(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

联系人: 黎明

经办律师: 黎明、孙睿

(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: 童咏静、朱宏宇

四、基金的名称

本基金名称: 交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型: 契约型开放式股票型基金。

六、基金份额的分级

本基金的基金份额包括本基金之基础份额 (即 “交银互联网金融份额”)、稳健收益类份额 (即 “交银互联网金融 A 份额”) 与积极收益类份额 (即 “交银互联网金融 B 份额”)。其中, 交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

七、场内份额的配对转换

本基金根据基金合同约定, 办理场内的交银互联网金融份额与交银互联网金

融 A 份额、交银互联网金融 B 份额之间的场内份额配对转换业务。包括以下两种方式的配对转换：

1、分拆：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份交银互联网金融份额的场内份额申请转换成 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额的行为。

2、合并：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额申请转换成 2 份交银互联网金融份额的场内份额的行为。

场外的交银互联网金融份额不可以进行份额配对转换，但通过跨系统转托管至证券登记结算系统后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

八、基金的投资目标

本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金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%。

九、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，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以后, 持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果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。

十、基金的投资策略

本基金为指数型基金, 绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数, 即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当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, 或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时, 或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下, 力争控制本基金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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%, 本基金投资于中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%, 其余资产可投资于其他股票 (非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具 (但须符合中国证监会相关规定), 其目的是在保证基金资产流动性的前提下, 有效利用基金资产, 更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在建仓期或者出现大量净申购或净赎回的情况时, 本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标

的指数的目的。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

十一、基金的业绩比较基准

中证互联网金融指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$

本基金的标的指数为中证互联网金融指数。中证互联网金融指数是由中证指数有限公司编制，代表性和可投资性受到市场认可。

由于本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金业绩比较基准中同时加入了 5% 的银行活期存款利率(税后)。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止中证互联网金融指数的编制、发布或授权，或中证互联网金融指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证互联网金融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，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在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等。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，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、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

除上述情形外，如果今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人可与本基金托

管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十二、基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级。风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征。但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

十三、基金投资组合报告

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

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期为 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日。本报告财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	66,900,996.01	92.94
	其中：股票	66,900,996.01	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,000.00	0.18
	其中：债券	131,000.00	0.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,937,245.11	6.86
8	其他各项资产	10,590.06	0.01
9	合计	71,979,831.18	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1、积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.2、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,498,038.84	18.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,179,750.00	1.65

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,867,404.00	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,924,245.56	38.96
J	金融业	19,700,131.90	27.49
K	房地产业	328,774.71	0.46
L	租赁和商务服务业	2,402,651.00	3.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,900,996.01	93.35

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600588	用友网络	70,173	2,839,199.58	3.96
2	002385	大北农	327,959	2,836,845.35	3.96
3	600570	恒生电子	27,704	2,435,181.60	3.40
4	300059	东方财富	145,070	2,328,373.50	3.25
5	300033	同花顺	21,096	2,291,025.60	3.20
6	601555	东吴证券	287,577	2,277,609.84	3.18
7	600109	国金证券	222,956	2,040,047.40	2.85
8	600177	雅戈尔	300,254	1,912,617.98	2.67

9	002024	苏宁易购	206,800	1,867,404.00	2.61
10	600271	航天信息	97,352	1,858,449.68	2.59

3.2、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	131,000.00	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,000.00	0.18

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110067	华安转债	1,310	131,000.00	0.18

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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

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

(2) 本基金投资的前十名股票中, 没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,833.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,021.91
5	应收申购款	6,734.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,590.06
---	----	-----------

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明

1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十四、基金的业绩

基金业绩截止日为 2020 年 3 月 31 日, 所载财务数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.79%	2.57%	-7.43%	2.59%	-0.36%	-0.02%
2019 年度	34.16%	1.77%	35.52%	1.77%	-1.36%	0.00%
2018 年度	-25.27%	1.65%	-25.61%	1.60%	0.34%	0.05%
2017 年度	-10.99%	0.96%	-8.85%	0.94%	-2.14%	0.02%
2016 年度	-24.72%	2.11%	-24.30%	1.95%	-0.42%	0.16%
2015 年(自基金合同生效日)	-8.70%	3.05%	-21.46%	3.31%	12.76%	-0.26%

起至 2015 年 12 月 31 日)						
-------------------------	--	--	--	--	--	--

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

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015 年 6 月 26 日至 2020 年 3 月 31 日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

十五、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金标的指数许可使用费；
- 4、基金上市初费及上市年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

自基金合同生效日起，基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

自基金合同生效日起，基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。费用自动扣划后，基金管理人应进

行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(3) 标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。通常情况下，本基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付，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。

如果标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计费方式，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。此项调整无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

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

2、与基金销售有关的费用

(1) 申购费

交银互联网金融份额的申购费用由基金申购人承担，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。

投资人可以多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金的场外申购费率如下：

申购费率	申购金额（含申购费）		场外申购费率
	50 万元以下		1.2%
	50 万元（含）至 100 万元		0.8%
	100 万元（含）至 200 万元		0.6%

	200 万元 (含) 至 500 万元	0.4%
	500 万元以上 (含 500 万)	每笔交易 1000 元

本基金的场内申购费率由场内销售机构参照上表场外申购费率设定。

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购交银互联网金融份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人直销柜台申购交银互联网金融份额的养老金客户特定申购费率如下表：

申购费率	申购金额 (含申购费)	特定申购费率
	50 万元以下	0.24%
	50 万元 (含) 至 100 万元	0.16%
	100 万元 (含) 至 200 万元	0.12%
	200 万元 (含) 至 500 万元	0.08%
	500 万元以上 (含 500 万)	每笔交易 1000 元

投资者通过直销机构交易享有如下费率优惠，有关费率优惠活动的具体费率折扣及活动起止时间如有变化，敬请投资者留意本基金管理人的有关公告，届时费率优惠相关事项以最新公告为准：

1) 通过本基金管理人直销柜台办理本基金基金份额申购业务的投资者，享受申购费率一折优惠；对上述实施特定申购费率的养老金客户而言，以其目前适用的特定申购费率和上述一般申购费率的一折优惠中孰低者执行。若享有折扣前的原申购费率为固定费用的，则按原固定费率执行，不再享有费率折扣。

2) 通过本基金管理人网上直销交易平台办理本基金基金份额申购业务的个人投资者享受申购费率优惠，赎回费率标准不变。具体优惠费率请参见本基金管理人网站列示的网上直销交易平台申购费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求，并依据相关法规的要求提前进行公告。

（2）赎回费

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，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。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

本基金的场外赎回费率如下：

赎回费率	持有期限	赎回费率
	7 日以内	1.5%
	7 日（含）—1 年（含）	0.5%
	1 年—2 年（含）	0.2%
	2 年以上	0

上表中的“年”指的是 365 个自然日。场外赎回交银互联网金融份额时，其持有期限的计算以中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则为准。

本基金的场内赎回费率如下：

赎回费率	持有期限	赎回费率
	7 日以内	1.5%
	7 日以上（含）	0.5%

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

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

（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) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、基金份额的折算

(一) 基金份额定期折算

交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金份额的定期折算。

1、基金份额定期折算基准日

每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的第一个工作日。

2、基金份额定期折算的对象

基金份额定期折算基准日登记在册的交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融份额。

3、基金份额定期折算频率

每个会计年度进行 1 次（可不进行定期折算的情形除外）。

4、基金份额定期折算方式

(1) 在每个基金份额定期折算基准日，本基金将对当日登记在册的交银互联网金融 A 份额进行应得收益的定期份额折算，交银互联网金融份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后，交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。

(2) 折算前的交银互联网金融 A 份额持有人, 以交银互联网金融 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分, 获得新增场内交银互联网金融份额的份额分配。交银互联网金融 A 份额持有人持有的交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变, 相应折算增加场内交银互联网金融份额。

(3) 折算前的交银互联网金融份额持有人, 以每 2 份交银互联网金融份额配比 1 份交银互联网金融 A 份额进行份额分配, 获得新增交银互联网金融份额。持有场外交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银互联网金融份额的分配; 持有场内交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银互联网金融份额的分配。

(4) 折算不改变交银互联网金融 B 份额持有人的资产净值, 其持有的交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值及份额数量不变。

按照上述折算方法, 由于计算过程尾差处理的原因, 可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差, 该误差归入基金财产, 视为未改变基金份额持有人的资产净值。

5、基金份额定期折算公式

(1) 交银互联网金融 A 份额

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

交银互联网金融 A 份额持有人持有的新增场内交银互联网金融份额的份额数为:

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中:

$NUM_A^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的份额数;

$NUM_A^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的份额数;

$NAV_A^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值;

$NAV_A^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值;

$NAV^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值;

$NAV^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融份额的基金份额净值。

(2) 交银互联网金融 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3) 交银互联网金融份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

折算后交银互联网金融份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为:

$$\frac{(NAV^{\text{前}} - NAV^{\text{后}}) \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后交银互联网金融份额的总份额数 = 定期份额折算前交银互联网金融份额的份额数 + 交银互联网金融份额持有人新增的交银互联网金融份额的份额数 + 交银互联网金融 A 份额持有人新增的交银互联网金融份额的份额数
其中:

$NUM^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的份额数;

$NAV^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值;

$NAV^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融份额的基金份额净值。

在实施基金份额折算时, 折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值、交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金份额定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额定期折算期间的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停交银互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额的上市交易、交银互联网金融份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

7、基金份额定期折算结果的公告

基金份额定期折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告, 并报中国证监会备案。

(二) 基金份额不定期折算

除以上定期份额折算外, 本基金还将在交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元或交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时进行不定期份额折算。

1、交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时的不定期折算

(1) 基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元, 基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期, 详见基金管理人届时发布的公告。

(2) 基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额、交银互联网金融份额。

(3) 基金份额不定期折算频率

不定期。

(4) 基金份额不定期折算方式

1) 折算前的交银互联网金融份额持有人, 获得新增交银互联网金融份额的份额分配。交银互联网金融份额持有人持有的交银互联网金融份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元, 份额数量相应折算增加;

2) 折算前的交银互联网金融 A 份额持有人, 以交银互联网金融 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分, 获得新增场内交银互联网金融份额的份额分配。交银互联网金融 A 份额持有人持有的交银互联网金融 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变, 相应折算增加场内交银互联网金融份额;

3) 折算前的交银互联网金融 B 份额持有人, 以交银互联网金融 B 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分, 获得新增场内交银互联网金融份额的份额分配。交银互联网金融 B 份额持有人持有的交银互联网金融 B 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变, 相应折算增加场内交银互

互联网金融份额。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5) 基金份额折算公式

1) 交银互联网金融 A 份额

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

折算后交银互联网金融 A 份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为：

$$NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值；

2) 交银互联网金融 B 份额

$$NAV_B^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_B^{\text{前}} = NUM_B^{\text{后}}$$

折算后交银互联网金融 B 份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为：

$$NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)$$

其中：

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银互联网金融 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银互联网金融 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV_B^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值；

3) 交银互联网金融份额

$$NAV^{\text{后}} = 1.000$$

折算后交银互联网金融份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为:

$$NUM^{\text{前}} \times (NAV^{\text{前}} - 1.000)$$

折算后交银互联网金融份额的总份额数=折算前交银互联网金融份额的份额数+交银互联网金融份额持有人新增的交银互联网金融份额数+交银互联网金融 A 份额持有人新增的场内交银互联网金融份额数+交银互联网金融 B 份额持有人新增的场内交银互联网金融份额数

其中:

$NUM^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的份额数;

$NAV^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值;

$NAV^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融份额的基金份额净值。

在实施基金份额折算时, 折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

2、交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时的不定期折算

(1) 基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元, 基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期, 详见基金管理人届时发布的公告。

(2) 基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额、交银互联网金融份额。

(3) 基金份额不定期折算频率

不定期。

(4) 基金份额不定期折算方式

1) 交银互联网金融份额持有人持有的交银互联网金融份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整;

2) 交银互联网金融 A 份额持有人持有的交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整, 相应折算增加交银互联网金融份额;

3) 折算不改变交银互联网金融 B 份额持有人的资产净值, 其持有的交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整;

4) 交银互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额的基金份额配比保持 1 : 1 的比例不变。

按照上述折算方法, 由于计算过程尾差处理的原因, 可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差, 该误差归入基金财产, 视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5) 基金份额折算公式

1) 交银互联网金融 B 份额

$$NAV_B^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中:

$NUM_B^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 B 份额的份额数;

$NUM_B^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 B 份额的份额数;

$NAV_B^{\text{前}}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值;

$NAV_B^{\text{后}}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值;

2) 交银互联网金融 A 份额

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

折算后交银互联网金融 A 份额持有人持有的新增交银互联网金融份额的份额数为:

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中:

$NUM_A^{前}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的份额数;

$NUM_A^{后}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的份额数;

$NAV_A^{前}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值;

$NAV_A^{后}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值;

3) 交银互联网金融份额

$$NAV^{后} = 1.000$$

折算后交银互联网金融份额持有人持有的交银互联网金融份额的份额数为:

$$\frac{NUM^{前} \times NAV^{前}}{1.000}$$

折算后交银互联网金融份额的总份额数=交银互联网金融份额持有人持有的折算后的交银互联网金融份额的份额数+交银互联网金融 A 份额持有人新增的场内交银互联网金融份额数

其中:

$NUM^{前}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的份额数;

$NAV^{前}$: 份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值;

$NAV^{后}$: 份额折算基准日折算后交银互联网金融份额的基金份额净值;

在实施基金份额折算时, 折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金份额不定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额不定期折算期间的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停交银互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额的上市交易、交银互联网金融份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

4、基金份额不定期折算结果的公告

基金份额不定期折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告, 并报中国证监会备案。

(三) 折算份额数的处理方式

上述定期或不定期折算后, 场外份额的份额数保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍去, 舍去部分所代表的资产计入基金财产; 场内份额的份额数取整计算 (最小单位为 1 份), 小数点以后的部分舍去, 舍去部分所代表的资产计入基金财产。

(四) 特殊情况的处理

基金合同生效日至第 1 个定期折算基准日不足 6 个月的, 则该年度可不进行定期折算。

若在某一个会计年度的定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时, 基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则, 根据具体情况选择按照定期份额折算规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算, 具体以基金管理人届时发布的公告为准。

(五) 基金管理人、深圳证券交易所、登记机构有权调整上述规则, 本基金《基金合同》将视需要进行相应修改, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会, 并在本基金更新的招募说明书中列示。

十七、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

- (一) 更新了“重要提示”中相关内容。
- (二) 更新了“三、基金管理人”中相关内容。
- (三) 更新了“四、基金托管人”中相关内容。
- (四) 更新了“五、相关服务机构”中相关内容。
- (五) 更新了“十三、基金的投资”中相关内容, 数据截止到 2020 年 3 月 31 日。
- (六) 更新了“十四、基金的业绩”中相关内容, 数据截止到 2020 年 3 月 31 日。
- (七) 更新了“二十七、其他应披露事项”中相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二〇年六月二十四日