



# 招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2022 年 12 月 14 日

公告时间：2022 年 12 月 9 日

## 目 录

一、重要声明与提示 .....	1
二、基金概览 .....	2
三、基金的募集与上市交易 .....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况 .....	5
五、基金主要当事人简介 .....	6
六、基金合同摘要 .....	10
七、基金财务状况 .....	11
八、基金投资组合 .....	13
九、重大事件揭示 .....	16
十、基金管理人承诺 .....	17
十一、基金托管人承诺 .....	18
十二、基金上市推荐人意见 .....	19
十三、备查文件目录 .....	20
附件：基金合同摘要 .....	21

## 一、重要声明与提示

《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金托管人江苏银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所（以下简称“上交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅于 2022 年 8 月 24 日在基金管理人网站（[www.cmfcchina.com](http://www.cmfcchina.com)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）披露的《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金二级市场交易简称：政金债基（基金扩位证券简称：政金债 5 年 ETF）
- 3、证券代码：511580
- 4、截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日基金份额总额：4,028,811.00 份
- 5、截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日基金份额净值：100.1947 元
- 6、本次上市交易份额：4,028,811.00 份
- 7、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 8、上市交易日期：2022 年 12 月 14 日
- 9、基金管理人：招商基金管理有限公司
- 10、基金托管人：江苏银行股份有限公司
- 11、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 12、上市推荐人：招商证券股份有限公司
- 13、申购赎回代理机构（以下简称“一级交易商”）：具体请见《关于开放招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金日常申购赎回业务的公告》以及相关公告。

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2022]1413号

2、基金运作方式：交易型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2022年8月29日至2022年9月9日。其中，网下现金认购的日期为2022年8月29日至2022年9月9日，网上现金认购的日期为2022年9月7日至2022年9月9日。

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售期限：网下现金认购10个工作日，网上现金发售3个工作日。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。

8、发售机构：

(1) 网下现金认购的直销机构

招商基金管理有限公司

(2) 网下现金认购的发售代理机构

网下现金认购的发售代理机构：国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、东方证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司。

(3) 网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

9、验资机构名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10、募集资金总额及入账情况

本基金于2022年8月29日起公开募集，基金募集工作已于2022年9月9日顺利结束。经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为402,867,000.00元人民币，网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息共计78,670.44元人民币。其中网上现金认购有效净认购资金产生的利息为人民币64,504.44元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额；通过基金管理人进行网下现金认购的利息结转的份额14,166.00份。

本次募集有效认购总户数为1,749户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集份额合计402,881,166.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2022 年 9 月 15 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

12、基金合同生效日：2022 年 9 月 15 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：402,881,166.00 份。

## （二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2022]338 号

2、上市交易日期：2022 年 12 月 14 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场交易简称：政金债基（基金扩位证券简称：政金债 5 年 ETF）

5、证券代码：511580

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

6、本次上市交易份额：4,028,811.00 份。

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

8、基金资产净值的披露：在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

### （一）持有人户数

截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日，本基金基金份额持有人户数为 1,749 户，平均每户持有的基金份额为 2,303 份。

### （二）持有人结构

截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日，基金份额合计为 4,028,811 份，机构投资者持有的本基金基金份额为 2,243,781 份，占基金总份额的 55.69%；个人投资者持有的本基金基金份额为 1,785,030 份，占基金总份额的 44.31%。

### （三）前十名基金份额持有人情况

截至公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日，本基金前十名基金份额持有人情况如下：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内总份额比例（%）
1	田峰	500,000.00	12.41%
2	平安证券股份有限公司	300,085.00	7.45%
3	浙商证券股份有限公司	300,028.00	7.45%
4	中国银河证券股份有限公司	300,000.00	7.45%
5	中信证券股份有限公司	300,000.00	7.45%
6	上海融致实业有限公司	200,000.00	4.96%
7	海通证券股份有限公司	200,000.00	4.96%
8	华润深国投信托有限公司－华润信托·利享 1 号单一资金信托	200,000.00	4.96%
9	安信证券股份有限公司	200,000.00	4.96%
10	富国基金－中国移动通信有限公司－富国基金优享 7 号单一资产管理计划	100,028.00	2.48%

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、公司概况

名称：招商基金管理有限公司

法定代表人：王小青

总经理：徐勇

成立日期：2002 年 12 月 27 日

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

注册资本：人民币 13.1 亿元

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2002]100 号

营业执照统一社会信用代码：9144030071093625X4

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。

存续期间：持续经营

电话：(0755) 83199596

传真：(0755) 83076974

联系人：赖思斯

#### 2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	55%
招商证券股份有限公司	45%

#### 3、内部组织结构及职能

公司设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投研部门、风控合规部门、营销部门、运营及综合部门等。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；风控合规部门主要负责风险控制、法律合规及稽核审计等工作；营销部门主要负责营销和市场推广等工作；运营及综合部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。

#### 4、人员情况

截至 2022 年 9 月 30 日，公司总人数为 561 人，其中硕士及博士学历 412 人，本科学历 142 人，其他 7 人。

#### 5、信息披露负责人及咨询电话

潘西里，0755-83196666。

## 6、基金管理业务情况

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金管理公司一共管理 258 只公募基金产品。

## 7、本基金基金经理简介

王闯先生，硕士。2010 年 9 月至 2013 年 7 月任德勤华永会计师事务所审计员，2013 年 8 月至 2014 年 12 月在平安财险从事财务工作。2014 年 12 月加入招商基金管理有限公司，曾任基金会计、交易员，先后从事债券核算及交易工作。2018 年 6 月起加入固定收益投资部，曾任研究员、投资经理，现任招商招裕纯债债券型证券投资基金基金经理（管理时间：2021 年 9 月 9 日至今）、招商添锦 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（管理时间：2021 年 9 月 9 日至今）、招商添旭 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（管理时间：2021 年 11 月 26 日至今）、招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2022 年 9 月 15 日至今）、招商招享纯债债券型证券投资基金基金经理（管理时间：2022 年 11 月 11 日至今）、招商招丰纯债债券型证券投资基金基金经理（管理时间：2022 年 11 月 11 日至今）。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：江苏银行股份有限公司（简称“江苏银行”）

住所：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

成立时间：2007 年 1 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：115.4 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可【2014】619 号

联系人：朱振兴

电话：025 - 58587832

### 2、主要人员情况

江苏银行托管业务条线现有员工 61 名，来自于基金、券商、托管行等不同的行业，具有会计、金融、法律、IT 等不同的专业知识背景，团队成员具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度；部门管理层有 20 年以上金融从业经验，精通国内外证券市场的运作。

### 3、基金托管业务经营情况

2014 年，江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务资格。江苏银行依

靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务。目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、基金公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金、QDII 专户资产等。江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银行同时可以为各类客户提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性化的托管增值服务。

## (二) 基金托管人的内部控制制度

### 1、内部风险控制目标

(1) 确保有关法律法规在托管业务中得到全面严格的贯彻执行;

(2) 确保我行有关托管的各项管理制度和业务操作规程在托管业务中得到全面严格的贯彻执行;

(3) 确保资产安全,保证托管业务稳健运行。

2、内部风险控制组织结构 由江苏银行内审部和资产托管部内设的监察稽核人员构成。资产托管部内部设置专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### 3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则。“实行全员、全程风险控制方法”,内部控制必须渗透到托管业务的各个操作环节,覆盖所有的岗位,不能留有任何死角。

(2) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念,以业务岗位为主体,从风险发生的源头加强内部控制,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则。各团队要及时建立健全各项规章制度,采取有效措施加强内部控制。发现问题,要及时处理,堵塞漏洞。

(4) 独立性原则。托管业务内部控制机构必须独立于托管业务执行机构,业务操作人员和检查人员必须分开,以保证内控机构的工作不受干扰。

## (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。利用投资监督系统,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,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。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) 每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核

实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

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

### **(三) 上市推荐人**

名称：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

电话：(0755) 82960223

传真：(0755) 82960141

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

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

### **(四) 基金验资机构**

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：付建超

电话：021-6141 8888

传真：021-6335 0177

经办注册会计师：吴凌志、江丽雅

联系人：吴凌志、江丽雅

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日，本基金的资产负债表如下：

#### 资产负债表

会计主体：招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 7 日

单位：人民币元

资产	本报告期末 2022 年 12 月 7 日
资产：	
银行存款	250,906,949.88
结算备付金	9,576,490.81
存出保证金	21,583.12
交易性金融资产	298,421,067.77
其中：股票投资	-
债券投资	298,421,067.77
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计	558,926,091.58
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	92,000,000.00
应付证券清算款	63,214,020.55
应付赎回款	-
应付管理人报酬	11,589.31

应付托管费	3,863.09
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利润	-
其他负债	31,111.08
负债合计	155,260,584.03
所有者权益：	
实收基金	402,881,166.00
未分配利润	784,341.55
所有者权益合计	403,665,507.55
负债与持有人权益总计	558,926,091.58

注：截至 2022 年 12 月 7 日，招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金的基金份额净值 100.1947 元，基金份额 4,028,811.00 份。

## 八、基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

截至本公告书公告日前两个工作日即 2022 年 12 月 7 日（以下称“报告期末”），本基金的投资组合如下：

### （一）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	-	-
3	固定收益投资	298,421,067.77	53.39
	其中：债券	298,421,067.77	53.39
	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	260,483,440.69	46.60
8	其他资产	21,583.12	0.00
9	合计	558,926,091.58	100.00

注：由于四舍五入的原因，“占基金总资产的比例”分项之和与合计可能有尾差。

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1. 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

截至 2022 年 12 月 7 日，本基金未持有股票。

#### 2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

截至 2022 年 12 月 7 日，本基金未持有港股通投资股票。

### （三）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

截至 2022 年 12 月 7 日，本基金未持有股票。

### （四）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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	298,421,067.77	73.93

	其中：政策性金融债	298,421,067.77	73.93
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	298,421,067.77	73.93

#### （五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018018	国开 2101	1,561,000	162,520,414.39	40.26
2	018012	国开 2003	668,470	70,410,348.01	17.44
3	018065	进出 2201	400,000	39,955,572.60	9.90
4	018014	国开 2005	120,600	12,415,968.25	3.08
5	018011	国开 2002	67,040	6,958,728.12	1.72

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

截至 2022 年 12 月 7 日，本基金未持有资产支持证券。

#### （七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至 2022 年 12 月 7 日，本基金未持有权证。

#### （八）投资组合报告附注

1、截至 2022 年 12 月 7 日，基金投资的前十名证券除国开 2002（证券代码 018011）、国开 2003（证券代码 018012）、国开 2005（证券代码 018014）、国开 2101（证券代码 018018）、进出 2101（证券代码 018063）、进出 2201（证券代码 018065）、国开 2001（证券代码 108606）、国开 2104（证券代码 108614）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

##### （1）国开 2002（证券代码 018011）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

##### （2）国开 2003（证券代码 018012）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

##### （3）国开 2005（证券代码 018014）

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

(4) 国开 2101 (证券代码 018018)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责, 多次受到监管机构的处罚。

(5) 进出 2101 (证券代码 018063)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因, 多次受到监管机构的处罚。

(6) 进出 2201 (证券代码 018065)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责、违反反洗钱法等原因, 多次受到监管机构的处罚。

(7) 国开 2001 (证券代码 108606)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责, 多次受到监管机构的处罚。

(8) 国开 2104 (证券代码 108614)

根据发布的相关公告, 该证券发行人在报告期内因违规经营、未依法履行职责, 多次受到监管机构的处罚。

2、根据基金合同规定, 本基金的投资范围不包括股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	21,583.12
2	应收证券清算款	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,583.12

(九) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2022 年 12 月 7 日, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(十) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2022 年 12 月 7 日, 本基金未持有股票。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

1、严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

2、真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

3、在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

1、严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

2、根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

4、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，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。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为招商证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的有关条件；
- 2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

### 十三、备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售机构申请查阅以下文件：

- 1、中国证监会准予招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
- 2、《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《招商中证政策性金融债 3-5 年交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、律师事务所法律意见书
- 7、中国证监会要求的其他文件

招商基金管理有限公司

2022 年 12 月 9 日

## 附件：基金合同摘要

### 一、基金合同当事人及其权利义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，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、上海证券交易所及基金登记机构相关业务规则、通知、指南的规定以及本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

(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、足额支付赎回对价；

(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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资人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) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

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

(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、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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；
  - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；
  - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；
  - (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
  - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

(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业监督管理机构，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

基金投资人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，基金投资人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名或盖章为必要条件。

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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项、申购对价、赎回对价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。

若以本基金为目标基金，且基金管理人与本基金基金管理人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基

金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

本基金份额持有人大会暂不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

(一) 召开事由

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (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) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被相关证券交易所终止上市的情形除外；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(3) 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；

(4) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户、质押等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等），或证券交易所和登记机构调整上述业务规则；

(5) 调整基金的申购赎回方式；

(6) 调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(7) 基金推出新业务或服务；

(8) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通跨系统转托管业务或增加场外申购赎回业务；

(9) 调整基金收益分配原则；

(10) 本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；

(11) 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或在规定时间内未能作出书面答复，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或在规定时间内未能作出书面答复，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或在规定时间内未能作出书面答复，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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二分之一（含二分之一）；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所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的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、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人可采用书面、网络、电话、短信或其他方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### （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二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

###### （2）通讯开会

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

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规另有规定或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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

(九) 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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与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、基金的收益与分配

### (一) 基金收益分配原则

- 1、本基金收益分配方式为现金分红；
- 2、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.10% 以上时，可进行收益分配；
- 3、在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，

计算方法参见招募说明书；

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，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，基金管理人可在不违反法律法规规定的前提下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规定媒介公告。

## （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## （三）收益分配方案的确定、公告与实施

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

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

# 四、基金费用与税收

## （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易、结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；

- 8、基金相关账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金上市费及年费、IOPV 计算与发布费用；
- 10、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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。

上述“(一) 基金费用的种类”中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、基金的标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；
- 5、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的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 五、基金的投资

#### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。

#### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。

为更好实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债，政策性金融债，央行票据），债券回购，银行存款（包括定期存款，协议存款，通知存款等），现金等货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例：建仓完成后，本基金投资于待偿期在 3 年至 5 年（包含 3 年和 5 年）的标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。

#### （三）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于待偿期在 3 年至 5 年（包含 3 年和 5 年）的标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；完全按照

有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种，不受前述比例限制；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种，不受前述比例限制；

(4) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(7) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(8) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述 (5)、(6) 情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，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。

法律法规或监管部门取消上述禁止行为规定，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，不需经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。

#### （四）标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为中证政策性金融债 3-5 年指数。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证政策性金融债 3-5 年指数收益率。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）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。

### （二）估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，采用估值技术确定公允价值。

(2) 交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，采用估值技术确定公允价值。

(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

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

3、全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、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。

7、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。

基金管理人负责基金资产净值计算和基金会计核算，并担任基金会计责任方。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净值信息的计算结果对外予以公布。

### (三) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前且开始办理基金份额申购或者赎回前，

基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

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

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

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(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，保存年限不低于法律法规规定的最低期限。

## 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》相关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，根据该院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。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，《基金合同》当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### **九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

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