

# 招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易 型开放式指数证券投资基金联接基金更新 的招募说明书（二零二零年第三号）

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

截止日：2020年06月10日

## 重要提示

招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2011 年 4 月 27 日《关于核准深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》（证监许可〔2011〕605 号文）核准公开募集。本基金的基金合同于 2011 年 6 月 27 日正式生效。本基金为契约型开放式。

招商基金管理有限公司（以下称“本基金管理人”或“管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需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。投资者享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，TMT 行业投资的特定风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，以及本基金投资策略所特有的风险等。

本基金为深证 TMT50ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别。

1、在基金的投资方法方面，深证 TMT50ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接方法，通过将绝大部分基金财产投资于深证 TMT50ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

2、在交易方式方面，投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖深证 TMT50ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎深证 TMT50ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。

本基金与深证 TMT50ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：（1）法律法规对投资比例的要求。深证 TMT50ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（2）申购赎回的影响。深证 TMT50ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申购赎回采取现金方式，大额申购赎回可能会对基金净值产生一定冲击。

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。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

投资有风险，过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

《基金合同》生效后，基金招募说明书信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书，并登载在指定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书。

关于基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》实施之日起一年后开始执行。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2020 年 6 月 10 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2020 年 3 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已于 2020 年 6 月 19 日复核了本次更新的招募说明书。

## 目录

§1 绪言.....	5
§2 释义.....	6
§3 基金管理人.....	11
§4 基金托管人.....	22
§5 相关服务机构.....	24
§6 基金的募集与基金合同的生效.....	51
§7 基金份额的申购、赎回及转换.....	52
§8 基金的非交易过户、转托管、冻结和质押.....	62
§9 基金的投资.....	63
§10 基金的业绩.....	74
§11 基金的财产.....	76
§12 基金资产的估值.....	78
§13 基金的收益与分配.....	83
§14 基金的费用与税收.....	85
§15 基金的会计与审计.....	88
§16 基金的信息披露.....	89
§17 风险揭示.....	94
§18 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	99
§19 基金合同的内容摘要.....	101
§20 基金托管协议的内容摘要.....	115
§21 对基金份额持有人的服务.....	125
§22 其他应披露事项.....	127
§23 招募说明书存放及其查阅方式.....	129
§24 备查文件.....	130

## § 1 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等相关法律法规和《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## § 2 释义

在本招募说明书中，除非另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金合同：	《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
中国：	中华人民共和国(仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规：	中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
招募说明书：	《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其更新
份额发售公告：	《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 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》
托管协议：	基金管理人和基金托管人签订的《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效的修订及补充
中国证监会：	中国证券监督管理委员会
中国银监会：	中国银行保险监督管理委员会
《基金法》：	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》：	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》：	《公开募集证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》：	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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

指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的  
《流动性规定》：  
《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

元：  
中国法定货币人民币元

基金管理人：  
招商基金管理有限公司

基金托管人：  
中国银行股份有限公司

注册登记业务：  
基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基  
金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发  
放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

基金注册登记机构：  
招商基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金  
注册登记的机构

基金份额持有人：  
根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者  
受基金合同约定，根据基金合同享受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

基金合同当事人：  
个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规  
或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的  
总称

个人投资者：  
符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然  
人

机构投资者：  
符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合  
法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企  
业法人、事业法人、社会团体和其他组织

合格境外机构投资者：  
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  
法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金  
的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他  
资产管理机构

标的指数：  
指深圳证券信息有限公司和深圳证券交易所编制并发布的深  
证电子信息传媒产业 50 指数（简称“深证 TMT50 指数”）及  
其未来可能发生的变更

目标 ETF:	指深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金（简称“深证 TMT50ETF”）
ETF 联接基金:	是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF（以下简称目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。简称联接基金
基金募集期:	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
基金合同生效日:	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
基金存续期:	基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天:	公历日
月:	公历月
工作日:	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
认购:	在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售:	在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购:	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为
赎回:	基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为
巨额赎回:	在单个开放日，本基金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）超过上一日本基金总份额的 10%时的情形
基金转换:	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的某一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为



转托管：	投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
定期定额投资计划：	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
代销机构：	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构：	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点：	基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
基金账户：	基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户：	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
开放日：	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日：	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日：	自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数
收益分配基准日：	期末可供分配利润计算截止日
基金可供分配利润：	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部分的孰低数
基金资产总值：	基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值：	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金资产估值：	计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
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
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定 互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国 证监会基金电子披露网站）等媒介
不可抗力：	本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
销售服务费：	指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔 费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用
基金份额分类：	本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同 的类别。不同类别的基金份额分设不同的基金代码，并分别 公布基金份额净值
A 类基金份额：	不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额
C 类基金份额：	从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类 基金份额
基金产品资料概要：	指《深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证 券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## § 3 基金管理人

### 3.1 基金管理人概况

公司名称：招商基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

设立日期：2002 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 13.1 亿元

法定代表人：刘辉

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

电话：（0755）83199596

传真：（0755）83076974

联系人：赖思斯

股权结构和公司沿革：

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会证监基金字[2002]100 号文批准设立，是中国第一家中外合资基金管理公司。目前公司注册资本金为人民币十三亿一千万元（RMB1,310,000,000 元），股东及股权结构为：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）持有公司全部股权的 45%。

2002 年 12 月，公司由招商证券、ING Asset Management B.V.（荷兰投资）、中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司共同投资组建，成立时注册资本金人民币一亿元，股东及股权结构为：招商证券持有公司全部股权的 40%，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的 30%，中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司各持有公司全部股权的 10%。

2005 年 4 月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，公司注册资本金由人民币一亿元增加至人民币一亿六千万元，股东及股权结构不变。

2007 年 5 月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，招商银行受让中国电力财务有限公司、中国华能财务有限责任公司、中远财务有限责任公司及招商证券分别持有的公司 10%、10%、10%及 3.4%的股权；ING Asset Management B.V.（荷兰投资）受让招商证券持有的公司 3.3%的股权。上述股权转让完成后，公司的股东及股权结构为：招商银行持有公司全部股权的 33.4%，招商证券持有公司全部股权的 33.3%，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）持有公司全部股权的 33.3%。同时，公司注册资本金由人民币一亿六千万元增加至人民币二亿一千万元。

2013年8月，经公司股东会审议通过并经中国证监会批复同意，ING Asset Management B.V.（荷兰投资）将其持有的公司21.6%股权转让给招商银行、11.7%股权转让给招商证券。上述股权转让完成后，公司的股东及股权结构为：招商银行持有全部股权的55%，招商证券持有全部股权的45%。

2017年12月，经公司股东会审议通过并经报备中国证监会，公司股东招商银行和招商证券按原有股权比例向公司同比例增资人民币十一亿元。增资完成后，公司注册资本由人民币二亿一千万元增加至人民币十三亿一千万元，股东及股权结构不变。

公司主要股东招商银行股份有限公司成立于1987年4月8日。招商银行始终坚持“因您而变”的经营服务理念，已成长为中国境内最具品牌影响力的商业银行之一。2002年4月9日，招商银行在上海证券交易所上市（股票代码：600036）；2006年9月22日，招商银行在香港联合交易所上市（股份代号：3968）。

招商证券股份有限公司是百年招商局集团旗下的证券公司，经过多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商。2009年11月17日，招商证券在上海证券交易所上市（代码600999）；2016年10月7日，招商证券在香港联合交易所上市（股份代号：6099）。

公司以“为投资者创造更多价值”为使命，秉承诚信、理性、专业、协作、成长的核心价值观，努力成为中国资产管理行业具有差异化竞争优势、一流品牌的资产管理公司。

## 3.2 主要人员情况

### 3.2.1 董事会成员

刘辉女士，经济学硕士。1995年4月加入招商银行股份有限公司，2010年至2013年任招商银行计划财务部副总经理，2013年至2015年任招商银行市场风险管理部总经理，2015年至2017年任招商银行资产负债管理部总经理兼招商银行投资管理部总经理，2017年12月起任招商银行投行与金融市场总部总裁兼招商银行资产管理部总经理。2019年4月起任招商银行行长助理兼招商银行资产管理部总经理，同时兼任招银理财有限责任公司董事长、招银金融租赁有限公司董事。现任公司董事长。

金旭女士，北京大学硕士研究生。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年6月至2014年12月任国泰基金管理有限公司总经理。2015年1月加入招商基金管理有限公司，2015年4月起任公司总经理、董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事长，2018年7月起任公司副董事长、总经理兼招商资产管理（香港）有限公司董事长，现任公司副董事长兼招商资产管理（香港）有限公司董事长。

杜凯先生，工商管理硕士。1992年8月至1993年11月先后在蛇口工业区商业服务公司和蛇口集装箱码头有限公司工作。1993年12月起在招商证券股份有限公司工作，历任证券营业部交易员、市场拓展部副主任、经理助理、负责人，深圳分公司总经理，渠道管理部总经理，财富管理及机构业务总部负责人。2019年5月起兼任招商证券资产管理有限公司董事、招商期货有限公司董事、招商致远资本投资有限公司董事。现任公司董事。

王小青先生，复旦大学经济学博士。1992年7月至1994年9月在中国农业银行江苏省海安支行工作。1997年7月至1998年5月在海通证券股份有限公司基金管理部工作。1998年5月至2004年4月在中国证监会上海专员办工作。2004年4月至2005年4月在天一证券有限责任公司工作。2005年4月至2007年8月历任中国人保资产管理有限公司风险管理部副总经理兼组合管理部副总经理、组合管理部副总经理、组合管理部总经理。2007年8月至2020年3月历任中国人保资产管理有限公司总裁助理、副总裁，党委委员、党委副书记，投委会主任委员等职。2020年3月加入招商基金管理有限公司，现任公司党委书记、董事、总经理。

何玉慧女士，加拿大皇后大学荣誉商学士。曾先后就职于加拿大 National Trust Company 和 Ernst&Young，1995年4月加入香港毕马威会计师事务所，2015年9月退休前系香港毕马威会计师事务所金融业内部审计、风险管理和合规服务主管合伙人。目前兼任泰康保险集团股份有限公司、汇丰前海证券有限公司、建信金融科技有限公司、南顺（香港）集团的独立董事，同时兼任多个香港政府机构辖下委员会及审裁处的成员和香港会计师公会纪律评判小组成员。现任公司独立董事。

张思宁女士，博士研究生。1989年8月至1992年11月历任中国金融学院国际金融系助教、讲师。1992年11月至2012年6月历任中国证监会发行监管部副处长、处长、副主任，中国证监会上市公司监管部副主任、正局级副主任，中国证监会创业板部主任。2012年6月至2014年6月任上海证监局党委书记、局长。2014年6月至2017年4月历任中国证监会创新部主任、打非局局长。2017年5月起任证通股份有限公司董事长。现任公司独立董事。

邹胜先生，管理学硕士。1992年12月至1996年12月在深圳证券登记有限公司历任电脑工程部经理、系统运行部经理。1996年12月至2017年2月在深圳证券交易所历任系统运行部副总监、武汉中心主任、创业板存管结算部副总监、电脑工程部总监、总经理助理、副总经理，其中2013年4月至2017年2月兼任深圳证券通信有限公司董事长。2017年3月起任深圳华锐金融技术股份有限公司董事长。此外，兼任深圳华锐金融技术股份有限公司下属公司上海华锐软件有限公司董事长、华锐分布式（北京）技术有限公司董事长、华锐分布式技术（长沙）有限公司董事长、华锐合胜数字科技（上海）有限公司董事长，同时兼任深圳协和信息技术企业（有限合伙）执行事务合伙人、深圳丰和技术投资企业（有限合伙）执行事务合伙人、深圳平和投资企业（有限合伙）执行事务合伙人、深

圳泰和技术投资企业（有限合伙）执行事务合伙人，兼任深圳市金融科技协会联席会长，兼任深圳中云信链科技股份有限公司股东、董事。现任公司独立董事。

### 3.2.2 监事会成员

周语菡女士，硕士研究生，先后就读于中国人民大学及加州州立大学索诺玛分校。自2008年3月至2014年9月以及自2002年3月至2005年9月任招商局中国基金有限公司执行董事；自2008年2月至2014年5月以及自2002年2月至2005年7月任招商局中国投资管理有限公司董事总经理；自2007年9月至2013年11月任招商基金独立董事；自2008年5月至2014年5月任江西世龙实业股份有限公司独立董事；自2008年4月至2013年10月任兴业银行股份有限公司监事。2014年7月起任招商证券股份有限公司监事会主席。现任公司监事会主席。

彭家文先生，中南财经大学国民经济计划学专业本科，武汉大学计算机软件专业本科。2001年9月加入招商银行股份有限公司。历任招商银行计划资金部经理、高级经理，计划财务部总经理助理、副总经理。2011年11月起任零售综合管理部副总经理、总经理。2014年6月起任招商银行零售金融总部副总经理、副总裁。2016年2月起任招商银行零售金融总部副总裁兼招商银行零售信贷部总经理。2017年3月起任招商银行郑州分行行长。2018年1月起任招商银行资产负债管理部总经理。现任公司监事。

罗琳女士，厦门大学经济学硕士。1996年加入招商证券股份有限公司投资银行部，历任项目经理、高级经理、业务董事；2002年起参与招商基金管理有限公司筹备，公司成立后先后历任基金核算部高级经理、产品研发部高级经理、副总监、总监、产品运营官、市场推广部总监，现任首席市场官兼银行渠道业务总部总监、渠道财富管理部总监、公司监事。

鲁丹女士，中山大学国际工商管理硕士。2001年加入美的集团股份有限公司任 Oracle ERP 系统实施顾问；2005年5月至2006年12月于韬睿惠悦咨询有限公司任咨询顾问；2006年12月至2011年2月于怡安翰威特咨询有限公司任咨询总监；2011年2月至2014年3月任倍智人才管理咨询有限公司首席运营官；2014年4月加入招商基金管理有限公司，现任公司战略与人力资源总监兼人力资源部总监、公司监事，兼任招商财富资产管理有限公司董事。

李扬先生，中央财经大学经济学硕士。2002年加入招商基金管理有限公司，历任基金核算部高级经理、副总监、总监，现任产品运营官兼产品管理部负责人、公司监事。

### 3.2.3 公司高级管理人员

王小青先生，总经理，简历同上。

钟文岳先生，常务副总经理，厦门大学经济学硕士。1992年7月至1997年4月于中国农村发展信托投资公司任福建（集团）公司国际业务部经理；1997年4月至2000年1月于申银万国证券股份有限公司任九江营业部总经理；2000年1月至2001年1月任厦门海发投资股份有限公司总经理；2001年1月至2004年1月任深圳二十一世纪风险投资公司副总经理；2004年1月至2008年11月任新江南投资有限公司副总经理；2008年11月至2015年6月任招商银行股份有限公司投资管理部总经理；2015年6月加入招商基金管理有限公司，现任公司常务副总经理兼招商财富资产管理有限公司董事。

沙骏先生，副总经理，南京通信工程学院工学硕士。2000年11月加入宝盈基金管理有限公司，历任TMT行业研究员、基金经理助理、交易主管；2008年2月加入国泰基金管理有限公司，历任交易部总监、研究部总监，投资总监兼基金经理，量化&保本投资事业部总经理；2015年加入招商基金管理有限公司，现任公司副总经理兼招商资产管理（香港）有限公司董事。

欧志明先生，副总经理，华中科技大学经济学及法学双学士、投资经济硕士。2002年加入广发证券深圳业务总部任机构客户经理；2003年4月至2004年7月于广发证券总部任风险控制岗从事风险管理工作；2004年7月加入招商基金管理有限公司，曾任法律合规部高级经理、副总监、总监、督察长，现任公司副总经理、首席信息官、董事会秘书，兼任招商财富资产管理有限公司董事兼招商资产管理（香港）有限公司董事。

杨渺先生，副总经理，经济学硕士。2002年起先后就职于南方证券股份有限公司、巨田基金管理有限公司，历任金融工程研究员、行业研究员、助理基金经理。2005年加入招商基金管理有限公司，历任高级数量分析师、投资经理、投资管理二部(原专户资产投资部)负责人及总经理助理，现任公司副总经理。

潘西里先生，督察长，法学硕士。1998年加入大鹏证券有限责任公司法律部，负责法务工作；2001年10月加入天同基金管理有限公司监察稽核部，任职主管；2003年2月加入中国证券监督管理委员会深圳监管局，历任副主任科员、主任科员、副处长及处长；2015年加入招商基金管理有限公司，现任公司督察长。

### 3.2.4 基金经理

苏燕青女士，硕士。2012年1月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任ETF专员，协助指数类基金产品的投资管理工作，现任深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2017年1月13日至今）、上证消费80交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2017年1月13日至今）、招商上证消费80交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（管理时间：2017年1月13日至今）、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金

经理（管理时间：2017年1月13日至今）、招商沪深300高贝塔指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2017年7月1日至今）、招商沪深300地产等权重指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2017年7月1日至今）、招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理（管理时间：2017年7月1日至今）、招商富时中国A-H50指数型证券投资基金（LOF）基金经理（管理时间：2018年12月3日至今）、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2020年3月20日至今）。

本基金历任基金经理包括：王平先生，管理时间为2011年6月27日至2017年1月13日；罗毅先生，管理时间为2013年1月19日至2017年7月1日；刘重杰先生，管理时间为2018年5月5日至2020年1月2日。

### 3.2.5 投资决策委员会成员

公司的投资决策委员会由如下成员组成：副总经理沙骏、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、总经理助理兼投资管理一部总监王景、副总经理杨渺、基金经理白海峰、固定收益投资部副总监马龙、投资管理四部总监助理付斌。

### 3.2.6 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 3.3 基金管理人的职责

根据《基金法》，基金管理人必须履行以下职责：

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回及转换价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。



### 3.4 基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺不得从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》等法律法规及规章的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

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

3、基金管理人禁止利用基金财产从事以下投资或活动：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的和目标 ETF 除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、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；

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

(8) 除为公司进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、本基金管理人承诺履行诚信义务，如实披露法规要求的披露内容。

6、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、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

### 3.5 内部控制制度

1、内部控制的原则

健全性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、成本效益原则。

2、内部控制的组织体系

公司的内部控制组织体系是一个权责分明、分工明确的组织结构，以实现对公司从决策层到管理层和操作层的全面监督和控制。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 监事会：监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。

(2) 董事会风险控制委员会：风险控制委员会作为董事会下设的专门委员会之一，负责决定公司各项重要的内部控制制度并检查其合法性、合理性和有效性，负责决定公司风险管理战略和政策并检查其执行情况，审查公司关联交易和检查公司的内部审计和业务稽查情况等。

(3) 督察长：督察长负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并负责组织指导公司监察稽核工作。督察长发现基金和公司存在重大风险或隐患，或发生督察长依法认为需要报告的其他情形以及中国证监会规定的其他情形时，应当及时向公司董事会和中国证监会报告。

(4) 风险管理委员会：风险管理委员会是总经理办公会下设的负责风险管理的专业委员会，主要负责对公司经营管理中的重大问题和重大事项进行风险评估并作出决策，并针对公司经营管理活动中发生的重大突发性事件和重大危机情况，实施危机处理机制。

（5）监察稽核部门：监察稽核部门负责对公司内部控制制度和风险管理政策的执行情况进行合规性监督检查，向公司风险管理委员会和总经理报告。

（6）各业务部门：风险控制是每一个业务部门和员工最首要的责任。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、自己的岗位职责进行自律。

### 3、内部控制制度概述

#### （1）内控制度概述

公司内控制度由内部控制大纲、公司基本制度、部门管理办法和业务管理办法组成。

其中，公司内控大纲包括《内部控制大纲》和《法规遵循政策（风险管理制度）》，它们是各项基本管理制度的纲要和总揽，是对公司章程规定的内控原则的细化和展开。

公司基本制度包括投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、监察稽核制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度、人力资源管理制度和危机处理制度等。部门管理办法在公司基本制度基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责进行了规范。业务管理办法对公司各项业务的操作进行了规范。

#### （2）风险控制制度

内部风险控制制度由一系列的具体制度构成，具体包括内部控制大纲、法规遵循政策、岗位分离制度、业务隔离制度、标准化作业流程制度、集中交易制度、权限管理制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

#### （3）监察稽核制度

公司设立相对独立的内部控制组织体系和监察稽核部门。监察稽核部门的职责是依据国家的有关法律法规、公司内部控制制度在所赋予的权限内按照所规定的程序和适当的方法对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价，包括调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性、检查公司执行国家法律法规和公司规章制度的情况、进行日常风险控制的监控工作、执行公司内部定期不定期的内部审计、调查公司内部的违法案件等。

### 4、内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控。

#### （1）控制环境

公司致力于树立内控优先和风险控制的理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的风险控制的文化氛围和环境，使全体员工及时了解相关的法律法规、管理层的经营思想、公司的规章制度并自觉遵循，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个业务环节。

#### （2）风险评估

公司对组织结构、业务流程、经营运作活动进行分析，发现风险，并将风险进行分类，找出风险分布点，并对风险进行分析和评估，找出引致风险产生的原因，采取定性定量的手段分析考量风险的高低和危害程度。落实责任人，并不断完善相关的风险防范措施。

### （3）控制活动

公司控制活动主要包括组织结构控制、操作控制和会计控制等。

#### A. 组织结构控制

各部门的设置体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场营销部等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立、相互牵制并且有独立的报告系统，形成了权责分明、严密有效的三道监控防线：

a. 以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线：各部门内部工作岗位合理分工、职责明确，并有相应的岗位说明书和岗位责任制，对不相容的职务、岗位分离设置，使不同的岗位之间形成一种相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险。

b. 各相关部门、相关岗位之间相互监督和牵制的第二道监控防线：公司在相关部门、相关岗位之间建立标准化的业务操作流程、重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督和检查的责任。

c. 以督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

#### B. 操作控制

公司设定了一系列的操作控制的制度手段，如标准化业务流程、业务、岗位和空间隔离制度、授权分责制度、集中交易制度、保密制度、信息披露制度、档案资料保全制度、客户投诉处理制度等，控制日常运作和经营中的风险。

#### C. 会计控制

公司确保基金资产与公司自有财产完全分开，分帐管理，独立核算；公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上进行严格区分。公司对所管理的不同基金以及本基金下分别设立账户，分帐管理，以确保每只基金和基金资产的完整和独立。

### （4）信息沟通

即指及时地实现信息的流动，如自下而上的报告和自上而下的反馈。

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

公司制定管理和业务报告制度，包括定期报告制度和不定期报告制度。定期报告制度按照每日、每月、每年度等不同的时间频次进行报告。

A. 执行体系报告路线：各业务人员向部门负责人报告；部门负责人向分管领导、总经理报告；

B. 监督体系报告路线：公司员工、各部门负责人向监察稽核部门报告，监察稽核部门向总经理、督察长分别报告；

C. 督察长定期出具监察报告，报送董事会及其下设的风险控制委员会和中国证监会；如发现重大违规行为，应立即向董事会和中国证监会报告。

#### （5）内部监控

督察长和监察稽核部门人员负责日常监督工作，促使公司员工积极参与和遵循内部控制制度，保证制度有效地实施。公司监事会、董事会风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门对内部控制制度持续地进行检验，检验其是否符合规定要求并加以充实和改善，及时反映政策法规、市场环境、技术等因素的变化趋势，保证内控制度的有效性。

## § 4 基金托管人

### 4.1 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 4.2 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

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

### 4.3 证券投资基金托管情况

截至 2020 年 3 月 31 日，中国银行已托管 780 只证券投资基金，其中境内基金 735 只，QDII 基金 45 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### 4.4 托管业务的内部控制制度

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

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### 4.5 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## § 5 相关服务机构

### 5.1 基金份额销售机构

#### 5.1.1 直销机构

直销机构：招商基金管理有限公司

招商基金客户服务热线：400-887-9555（免长途话费）

招商基金官网交易平台

交易网站：www.cmfcchina.com

客服电话：400-887-9555（免长途话费）

电话：（0755）83076995

传真：（0755）83199059

联系人：李璟

招商基金机构业务部

地址：北京市西城区月坛南街1号院3号楼1801

电话：（010）56937404

联系人：贾晓航

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南塔15楼

电话：（021）38577388

联系人：胡祖望

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23楼

电话：（0755）83190401

联系人：任虹虹

招商基金直销交易服务联系方式

地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦11层招商基金客户服务部直销柜台

电话：（0755）83196359 83196358

传真：（0755）83196360

备用传真：（0755）83199266

联系人：冯敏

#### 5.1.2 代销机构

代销机构	代销机构信息
中国工商银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街55



	号 法定代表人：陈四清 电话：95588 传真：010-66107914 联系人：杨威
招商银行股份有限公司	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人：李建红 电话：（0755）83198888 传真：（0755）83195050 联系人：季平伟
中国银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：刘连舸 电话：95566 传真：（010）66594853 联系人：张建伟
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 法定代表人：周慕冰 电话：95599 传真：（010）85109219 联系人：贺倩
交通银行股份有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 法定代表人：任德奇 电话：（021）58781234 传真：（021）58408483 联系人：王菁
北京银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 法定代表人：张东宁 电话：95526 传真：010-66226045 联系人：周黎
华夏银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 法定代表人：李民吉 电话：（010）85238667 传真：（010）85238680 联系人：郑鹏
中国民生银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：洪崎 电话：95568 传真：（010）58092611

	联系人：穆婷
中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街 3 号 法定代表人：张金良 电话：95580 传真：（010）68858117 联系人：王硕
中信银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号 法定代表人：李庆萍 电话：95558 传真：（010）65550827 联系人：王晓琳
上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号 法定代表人：郑杨 电话：（021）61618888 传真：（021）63604199 联系人：赵守良
平安银行股份有限公司	注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 电话：95511-3 传真：（021）50979507 联系人：赵杨
包商银行股份有限公司	注册地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号 法定代表人：周学东 电话：0472-5189051 传真：0472-5189057 联系人：周雪晴
宁波银行股份有限公司	注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 法定代表人：陆华裕 电话：0574-87050038 传真：0574-87050024 联系人：印萍萍
大连银行股份有限公司	注册地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号 法定代表人：崔磊 电话：0411-82356695 传真：0411-82356594 联系人：朱珠
东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：东莞市东城区鸿福东路 2 号 法定代表人：王耀球 电话：0769-961122 传真：0769-22866282 联系人：钟燕珊
江苏江南农村商业银行股份有限公司	注册地址：常州市天宁区延宁中路 668 号

	<p>法定代表人：陆向阳          电话：0519-80585939          传真：0519-89995066          联系人：李仙</p>
渤海银行股份有限公司	<p>注册地址：天津市河东区海河东路 218 号          法定代表人：李伏安          电话：95541          传真：02258316569          联系人：王婷婷</p>
南京银行股份有限公司	<p>注册地址：南京市玄武区中山路 288 号          法定代表人：胡升荣          电话：95302          传真：025-86775376          联系人：赵世光</p>
广发银行股份有限公司	<p>住所地址：广州市越秀区东风东路 713 号          法定代表人：王滨          电话：020-38321497          传真：020-87310955          联系人：陈泾渭</p>
上海陆享基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室          办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼          法定代表人：陈志英          联系人：韦巍          电话：021-53398816          传真：021-53398801          客服电话：021-53398816          公司网址：www.luxxfund.com</p>
中信期货有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层          办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层          法定代表人：张皓          联系人：刘宏莹          电话：010-60833754          传真：010-57762999          客服电话：400-990-8826          公司网址：www.citicsf.com</p>
东海期货有限责任公司	<p>注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、</p>

	<p>27、29 号          办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号          东海证券大厦 8 楼          法定代表人：陈太康          电话：021-68757102/13681957646          传真：无          联系人：李天雨          客服电话：95531 或 400-8888588          公司网址：www.qh168.com.cn</p>
<p>国泰君安证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商          城路 618 号          办公地址：上海市静安区新闻路 669 号博华          广场 21 层          法定代表人：贺青          联系人：钟伟镇          电话：（021）38032284          传真：（021）38670666          客服电话：95521          公司网址：www.gtja.com</p>
<p>中信建投证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号          楼          办公地址：北京市朝内大街 188 号          法定代表人：王常青          电话：010-65608231          传真：010-65182261          联系人：刘畅          客服电话：4008-888-108          公司网址：www.csc108.com</p>
<p>国信证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号          国信证券大厦十六层至二十六层          办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号          国信证券大厦          法人代表人：何如          联系人：李颖          电话：0755-82130833          传真：0755-82133952          客服电话：95536          公司网址：www.guosen.com.cn</p>
<p>招商证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路          111 号</p>

	<p>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          联系人：黄婵君          电话：（0755）82960167          传真：（0755）82960141          客服电话：95565          公司网址：www.newone.com.cn</p>
<p>广发证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室          办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼          法定代表人：孙树明          联系人：黄岚          电话：（020）87555888          传真：（020）87555417          客服电话：95575 或 02095575          公司网址：www.gf.com.cn</p>
<p>中信证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座          办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦          法定代表人：张佑君          联系人：马静懿          电话：010-60833889          传真：010-60833739          客服电话：95548          公司网址：www.citics.com</p>
<p>中国银河证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层          办公地址：北京市西城区金融街 35 号国企大厦 C 座 5 层          法定代表人：陈共炎          电话：010-83574507          传真：010-66568990          联系人：辛国政          客服电话：95551 或 4008-888-888          公司网址：www.chinastock.com.cn</p>
<p>海通证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：上海市广东路 689 号</p>

	<p>办公地址：上海市广东路 689 号          法定代表人：周杰          联系人：赖奕欣          电话：021-63602722          传真：021-23219100          客服电话：95553 或 02195553 或 4008888001          公司网址：www.htsec.com</p>
<p>华泰联合证券有限责任公司（原联合证券）</p>	<p>注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A          办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层          法定代表人：江禹          联系人：盛宗凌、庞晓芸          电话：0755-82492000          传真：0755-82492962          客服电话：0755-82492010          公司网址：www.lhzq.com</p>
<p>申万宏源证券有限公司（原申银万国证券）</p>	<p>注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层          办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层          法定代表人：杨玉成          联系人：陈宇          电话：021-33388214          传真：021-33388224          客服电话：95523          公司网址：www.swhysc.com</p>
<p>长江证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号          办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦          法定代表人：李新华          联系人：奚博宇          电话：（027）65799999          传真：（027）85481900          客服电话：95579 或 4008-888-999          公司网址：www.95579.com</p>
<p>安信证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安</p>

	<p>联大厦 35 层、28 层 A02 单元          办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号          中国凤凰大厦 1 栋 9 层          法定代表人：王连志          联系人：刘志斌          电话：0755-82558323          传真：0755-82558355          客服电话：95517          公司网址：www.essence.com.cn</p>
<p>西南证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号          办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证          券大厦          法定代表人：廖庆轩          电话：023-63786141          传真：023-63786212          联系人：陈诚          客服电话：95355          公司网址：www.swsc.com.cn</p>
<p>万联证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11          号 18、19 楼全层          办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11          号高德置地广场 F 座 18、19 层          法定代表人：罗钦城          联系人：甘蕾          电话：020-38286026          传真：020-38286588          客服热线：4008888133          公司网址：www.wlzq.com.cn</p>
<p>民生证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 28          号民生金融中心 A 座 16-18 层          办公地址：北京市东城区建国门内大街 28          号民生金融中心 A 座 16-18 层          法定代表人：冯鹤年          电话：010-85127609          传真：010-85127917          联系人：韩秀萍          客服电话：95376          公司网址：www.msizq.com</p>
<p>国元证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号          办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽</p>

	<p>国际金融中心 A 座国元证券          法定代表人：俞仕新          联系人：米硕          电话：0551-68167601          传真：0551-62207773          客服电话：95578          公司网站：www.gyzq.com.cn</p>
<p>渤海证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室          办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号          法定代表人：安志勇          电话：022-28451922          传真：022-28451892          联系人：王星          客服电话：400-651-5988          公司网址：www.ewww.com.cn</p>
<p>华泰证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：南京市江东中路 228 号          办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼          法定代表人：张伟          电话：0755-82492193          传真：0755-82492962          联系人：庞晓芸          客服电话：95597          公司网址：www.htsc.com.cn</p>
<p>山西证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼          办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼          法定代表人：侯巍          电话：0351-8686721          传真：0351-8686619          联系人：郭辛          客服电话：95573          公司网址：www.i618.com.cn</p>
<p>中信证券（山东）有限责任公司（原中信万通）</p>	<p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001          办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层</p>



	<p>法定代表人：姜晓林          联系人：孙秋月          电话：（0532）85022026          传真：（0532）85022605          客服电话：95548          公司网址：sd.citics.com</p>
东吴证券股份有限公司	<p>注册地址：苏州工业园区星阳街5号          办公地址：苏州工业园区星阳街5号          法定代表人：范力          电话：0512-65581136          传真：0512-65588021          联系人：方晓丹          客服电话：95330          公司网址：www.dwjq.com.cn</p>
信达证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼          办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层          法定代表人：肖林          电话：010-83252185          传真：010-63080978          联系人：付婷          客服电话：95321          公司网址：www.cindasc.com</p>
方正证券股份有限公司	<p>注册地址：长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717          公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层          法定代表人：施华          联系人：徐锦福          电话：010-57398062          传真：010-57308058          客服电话：95571          公司网址：www.foundersc.com</p>
光大证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市静安区新闻路1508号          办公地址：上海市静安区新闻路1508号          法定代表人：周健男          联系人：姚巍          电话：021-22169502          传真：021-22169134</p>

	<p>客服电话: 95525 公司网址: <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a></p>
中信证券华南股份有限公司（原广州证券）	<p>注册地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 法定代表人: 胡伏云 联系人: 梁微 电话: 020-88836999 传真: 020-88836984 客服电话: 95396 公司网址: <a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a></p>
东北证券股份有限公司	<p>注册地址: 长春市生态大街 6666 号 办公地址: 长春市净月开发区生态大街 6666 号东北证券 503 室 法定代表人: 李福春 电话: 0431-85096972 传真: 0431-85096795 联系人: 刘子会 客服电话: 95360 公司网址: <a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a></p>
新时代证券股份有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 办公地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501 法定代表人: 叶顺德 电话: 010-83561146 传真: 010-83561001 联系人: 田芳芳 客户服务电话: 95399 公司网址: <a href="http://www.xsdzq.cn">www.xsdzq.cn</a></p>
大同证券有限责任公司	<p>注册地址: 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址: 山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人: 董祥 电话: 0351-4130322 传真: 0351-4130322 联系人: 薛津 客服电话: 4007-121212</p>

	公司网址： <a href="http://www.dtsbc.com.cn">www.dtsbc.com.cn</a>
浙商证券股份有限公司	<p>注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号</p> <p>办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7</p> <p>法定代表人：吴承根</p> <p>电话：0571-87902239</p> <p>传真：021-64713795</p> <p>联系人：胡相斌</p> <p>客服电话：95345</p> <p>公司网址： <a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a></p>
平安证券股份有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层</p> <p>办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层</p> <p>法定代表人：何之江</p> <p>联系人：王超</p> <p>电话：0755-22621866</p> <p>传真：0755-82400862</p> <p>客服电话：95511 转 8</p> <p>公司网址： <a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a></p>
华安证券股份有限公司	<p>注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号</p> <p>公司地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座</p> <p>法定代表人：章宏韬</p> <p>电话：0551-5161666</p> <p>传真：0551-5161600</p> <p>联系人：孙懿</p> <p>客服电话：95318</p> <p>公司网址： <a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a></p>
国海证券股份有限公司	<p>注册地址：广西桂林市辅星路 13 号</p> <p>办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号</p> <p>法定代表人：何春梅</p> <p>电话：(0755)83709350</p> <p>传真：(0755)83704850</p> <p>联系人：牛孟宇</p> <p>客服电话：(0771) 95563</p> <p>公司网址： <a href="http://www.ghzq.com.cn">www.ghzq.com.cn</a></p>

<p>国都证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层                  办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层                  法定代表人：王少华                  电话：010-84183333                  传真：010-84183311                  联系人：黄静                  客服电话：400-818-8118                  公司网址：www.guodu.com</p>
<p>申万宏源西部证券有限公司（原宏源证券）</p>	<p>注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室                  办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室                  法定代表人：李琦                  联系人：陈宇                  电话：021-33388214                  传真：021-33388224                  客服电话：4008000562                  公司网址：www.hysec.com</p>
<p>世纪证券有限责任公司</p>	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406                  办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层                  法定代表人：李强                  联系人：王雯                  电话：0755-83199599                  传真：0755-83199545                  客服电话：4008-323000                  公司网址：www.csco.com.cn</p>
<p>第一创业证券股份有限公司</p>	<p>注册地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼                  办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼                  法定代表人：刘学民                  电话：0755-23838751                  传真：0755-25838701                  联系人：吴军</p>

	<p>客服电话：95358 公司网址：www.firstcapital.com.cn</p>
中航证券有限公司	<p>注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 办公地址：北京市朝阳区安立路60号润枫德尚6号楼3层中航证券 法定代表人：王晓峰 电话：010-64818301 传真：010-64818443 联系人：胡晨 客服电话：95335 或 400-88-95335 公司网址：www.avicsec.com</p>
华龙证券股份有限公司	<p>注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼 办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦19楼 法定代表人：陈牧原 电话：0931-4890208、0931-8784656 传真：0931-4890628 联系人：范坤、杨力 客服电话：95368 或 400-6898888 公司网址：www.hlzqgs.com</p>
中国国际金融股份有限公司（中金公司）	<p>注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法定代表人：沈如军 联系人：蔡宇洲 电话：010-65051166 传真：010-65051166 客服电话：4009101166 公司网址：www.cicc.com</p>
华鑫证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房 办公地址：上海市肇嘉浜路750号 法定代表人：俞洋 电话：021-54967552 传真：021-64333051 联系人：杨莉娟</p>

	<p>客服电话：95323 或 400-109-9918 公司网址：www.cfsc.com.cn</p>
中国中金财富证券有限公司（原中投证券）	<p>注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 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 联系人：万玉琳 电话：0755-82026907 传真：0755-82026539 客服电话：95532 或 400-600-8008 公司网址：www.china-invs.cn</p>
中山证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层 办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层 法定代表人：林炳城 电话：0755-82570586 传真：0755-82940511 联系人：罗艺琳 客服电话：95329 公司网址：www.zszq.com</p>
粤开证券股份有限公司（原联讯证券）	<p>注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层 公司地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层 法定代表人：严亦斌 电话：0755-83331195 联系人：彭莲 客服电话：95564 公司网址：www.ykzq.com</p>
国金证券股份有限公司	<p>注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126</p>

	<p>联系人：刘婧漪、贾鹏                  客服电话：95310                  公司网址：www.gjq.com.cn</p>
方正证券承销保荐有限责任公司（原民族证券）	<p>注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼                  办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼                  法定代表人：陈琨                  电话：59355941                  传真：56437030                  联系人：李微                  客服电话：95571                  公司网址：www.e5618.com</p>
华宝证券有限责任公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层                  办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层                  法定代表人：刘加海                  电话：021-20515583                  传真：021-20515593                  联系人：胡星煜                  客服电话：400-820-9898                  公司网址：www.cnhbstock.com</p>
英大证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层                  办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层                  法定代表人：郝京春                  电话：0755-83007159                  传真：0755-83007034                  联系人：吴尔晖                  客服电话：4000-188-688                  公司网址：www.ydsc.com.cn</p>
华融证券股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街 8 号                  办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层                  法定代表人：张海文                  电话：010-85556095                  传真：010-85556088                  联系人：朱玉成</p>

	<p>客服电话：95390 公司网址：www.hrsec.com.cn</p>
太平洋证券股份有限公司	<p>注册地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼 办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元 法定代表人：李长伟 电话：010-88321613 传真：010-88321763 联系人：谢兰 客服电话：95397 公司网址：www.tpyzq.com</p>
中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券）	<p>注册地址：济南市市中区经七路 86 号 办公地址：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：秦雨晴 客服电话：95538 公司网址：www.zts.com.cn</p>
上海长量基金销售投资顾问有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 法定代表人：张跃伟 电话：400-820-2899 传真：021-58787698 联系人：敖玲</p>
深圳众禄基金销售股份有限公司	<p>注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 法定代表人：薛峰 电话：0755-33227950 传真：0755-82080798 联系人：童彩平</p>
蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	<p>注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号 法定代表人：陈柏青 电话：0571-28829790 传真：0571-26698533 联系人：韩松志</p>



北京展恒基金销售有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号 法定代表人：闫振杰 电话：010-62020088 传真：010-62020088-8802 联系人：周文婕
诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室 法定代表人：汪静波 电话：400-821-5399 传真：（021）38509777 联系人：李娟
上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 法定代表人：杨文斌 电话：（021）58870011 传真：（021）68596916 联系人：张茹
中期资产管理有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层 法定代表人：路瑶 电话：400-8888-160 传真：010-59539866 联系人：朱剑林
上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 法定代表人：其实 电话：400-1818-188 传真：021-64385308 联系人：潘世友
和讯信息科技有限公司	注册地址：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：400-9200-022 传真：0755-82029055 联系人：吴阿婷
浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

	<p>法定代表人：凌顺平          电话：0571-88911818          传真：0571-86800423          联系人：刘宁</p>
上海陆金所基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元          法定代表人：郭坚          电话：021-20665952          传真：021-22066653          联系人：宁博宇</p>
上海联泰资产管理有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室          法定代表人：燕斌          电话：400-046-6788          传真：021-52975270          联系人：凌秋艳</p>
北京虹点基金销售有限公司	<p>注册地址：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：郑毓栋          电话：400-068-1176          传真：010-56580660          联系人：于婷婷</p>
深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#          法定代表人：杨懿          电话：400-166-1188          传真：010-83363072          联系人：文雯</p>
深圳富济财富管理有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室          法定代表人：刘鹏宇          电话：0755-83999913          传真：0755-83999926          联系人：陈勇军</p>
嘉实财富管理有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元          法定代表人：赵学军          电话：400-021-8850</p>

	<p>联系人: 余永健 网址: <a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a></p>
珠海盈米财富管理有限公司	<p>注册地址: 广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 法定代表人: 肖雯 电话: 020-80629066 联系人: 刘文红 网址: <a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a></p>
上海汇付金融服务有限公司	<p>注册地址: 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人: 冯修敏 电话: 400-8213-999 联系人: 陈云卉 网址: <a href="https://tty.chinapnr.com/">https://tty.chinapnr.com/</a></p>
上海利得基金销售有限公司	<p>注册地址: 上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 2 楼 法定代表人: 李兴春 电话: 400-921-7755 联系人: 王淼晶 网址: <a href="http://www.leadfund.com.cn">www.leadfund.com.cn</a></p>
奕丰金融服务（深圳）有限公司	<p>注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 法定代表人: TAN YIK KUAN 电话: 400-684-0500 联系人: 陈广浩 网址: <a href="http://www.ifastps.com.cn">www.ifastps.com.cn</a></p>
南京苏宁基金销售有限公司	<p>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 电话: 025-66996699-887226 联系人: 王锋 网址: <a href="http://fund.suning.com">http://fund.suning.com</a></p>
北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>注册地址: 北京市海淀区北四环西路 58 号 906 法定代表人: 张琪 电话: 010-62675369 联系人: 付文红 网址: <a href="http://www.xincai.com/">http://www.xincai.com/</a></p>

北京钱景财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层 法定代表人：赵荣春 电话：400-893-6885 联系人：盛海娟 网址： <a href="http://www.qianjing.com/">http://www.qianjing.com/</a>
北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：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 电话：4000-618-518 联系人：戚晓强 网址： <a href="http://www.ncfj.com/">http://www.ncfj.com/</a>
深圳前海微众银行股份有限公司	注册地址：深圳市南山区桃园路田厦金牛广场 37 楼 法定代表人：顾敏 电话：400-999-8877 联系人：罗曦 网址： <a href="http://www.webank.com/">http://www.webank.com/</a>
上海万得投资顾问有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 法定代表人：王延富 电话：400-821-0203 联系人：徐亚丹 网址： <a href="http://www.520fund.com.cn/">http://www.520fund.com.cn/</a>
上海华信证券有限责任公司	注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼 法定代表人：郭林 电话：400-820-5999 联系人：徐璐 网址： <a href="http://www.shhxzq.com">www.shhxzq.com</a>
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 法定代表人：丁东华 电话：400-111-0889 联系人：郭宝亮 网址： <a href="http://www.gomefund.com">www.gomefund.com</a>
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 11 层 1108

	<p>法定代表人：王伟刚          电话：400-619-9059          联系人：丁向坤          网址：<a href="http://www.fundzone.cn">http://www.fundzone.cn</a></p>
南京途牛金融信息服务有限公司	<p>注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号          法定代表人：宋时琳          电话：400-799-9999          联系人：贺杰          网址：<a href="http://jr.tuniu.com">http://jr.tuniu.com</a></p>
凤凰金信（银川）投资管理有限公司	<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          法定代表人：程刚          电话：400-810-5919          联系人：张旭          网址：<a href="http://www.fengfd.com">www.fengfd.com</a></p>
上海中正达广投资管理有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室          法定代表人：黄欣          电话：400-6767-523          联系人：戴珉微          网址：<a href="http://www.zzwealth.cn">www.zzwealth.cn</a></p>
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）          法定代表人：王翔          电话：400-820-5369          联系人：吴鸿飞          网址：<a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a></p>
中民财富基金销售（上海）有限公司	<p>注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元          法定代表人：弭洪军          电话：400-876-5716          联系人：茅旦青          网址：<a href="http://www.cmiwm.com">www.cmiwm.com</a></p>
北京晟视天下投资管理有限公司	<p>注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室          法定代表人：蒋煜          电话：400-818-8866</p>

	<p>联系人：尚瑾 网址： <a href="http://www.gscaifu.com">www.gscaifu.com</a></p>
北京创金启富投资管理有限公司	<p>注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 法定代表人：梁蓉 电话：400-6262-818 联系人：魏素清 网址： <a href="http://www.5irich.com">www.5irich.com</a></p>
联储证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号东方汇经中心 8 楼 法定代表人：沙常明 电话：400-620-6868 联系人：唐露 网址： <a href="http://www.lczq.com/">http://www.lczq.com/</a></p>
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 号一幢二楼 268 室 法定代表人：李一梅 电话：13911253562 联系人：吴振宇 网址： <a href="https://www.amcfortune.com/">https://www.amcfortune.com/</a></p>
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 层 01、02/03 室 法定代表人：胡燕亮 电话：021-50810687 联系人：樊晴晴 网址： <a href="http://www.wacaijijin.com">www.wacaijijin.com</a></p>
北京肯特瑞基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157 法定代表人：王苏宁 电话：01089189288 联系人：邢锦超 网址： <a href="http://kenterui.jd.com/">http://kenterui.jd.com/</a> 客服热线： 95118</p>
通华财富(上海)基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼 法定代表人：兰奇 电话：95156 转 5 联系人：陈益萍 网址： <a href="http://www.tonghuafund.com">www.tonghuafund.com</a></p>

<p>深圳市前海排排网基金销售有限责任公司</p>	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室                      法定代表人：李春瑜                      电话：400-680-3928                      联系人：华荣杰                      网址：www.simuwang.com</p>
<p>天津万家财富资产管理有限公司</p>	<p>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                      法定代表人：李修辞                      电话：010-59013842                      联系人：王茜蕊                      网址：http://www.wanjiawealth.com</p>
<p>上海有鱼基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室                      法定代表人：林琼                      客服电话：4007676298                      联系人：徐海峰                      公司网址：www.youyufund.com</p>
<p>北京植信基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼                      法定代表人：于龙之                      客服电话：4006-802-123                      邮箱：services@zhixin-inv.com                      公司网址：https://www.zhixin-inv.com/</p>
<p>腾安基金销售（深圳）有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦11楼                      法定代表人：刘明军                      客服电话：95017 转 1 转 6 或 0755-86013388                      公司网址：https://www.tenganxinxi.com/</p>
<p>北京恒天明泽基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室                      法定代表人：周斌                      联系人：马鹏程                      联系电话：010-57756074                      客服电话：400-786-8868                      公司网址：http://www.chtfund.com</p>

<p>济安财富（北京）基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 3 层 307 单元                  法定代表人：杨健                  联系人：李海燕                  联系电话：13501184929                  客服电话：400-673-7010                  公司网址：<a href="http://www.jianfortune.com/">http://www.jianfortune.com/</a></p>
<p>民商基金销售(上海)有限公司</p>	<p>注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室                  法定代表人：贲惠琴                  联系人：董筱爽                  联系电话：18121169537                  客服电话：021-50206003                  公司网址：<a href="http://www.msftec.com">www.msftec.com</a></p>
<p>上海大智慧基金销售有限公司</p>	<p>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 单元                  法定代表人：申健                  联系人：施燕华                  联系电话：18901685505                  客服电话：021-20292031                  公司网址：<a href="https://www.wg.com.cn">https://www.wg.com.cn</a></p>
<p>北京百度百盈基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101                  法定代表人：张旭阳                  联系人：王语妍                  联系电话：13810785862                  客服电话：95055-9                  公司网址：<a href="https://www.baiyingfund.com/">https://www.baiyingfund.com/</a></p>
<p>阳光人寿保险股份有限公司</p>	<p>注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层                  法定代表人：李科                  联系人：王超                  联系电话：010-59053660                  客服电话：95510                  公司网址：<a href="http://fund.sinosig.com">fund.sinosig.com</a></p>
<p>江苏汇林保大基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号                  法定代表人：吴言林                  联系人：林伊灵</p>



	<p>联系电话：025-66046166（分机号转 810）          客服电话：025-66046166          公司网址：www.huilinbd.com</p>
华瑞保险销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东区向城路 288 号 8 楼          法定代表人：路昊          联系人：张爽爽          联系电话：021-68595976          客服电话：4001115818          公司网址：www.huaruisales.com</p>
玄元保险代理有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室          法定代表人：马永谔          联系人：卢亚博          联系电话：13752528013          客服电话：021-50701053          公司网址：  <a href="http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx">http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx</a></p>
中证金牛（北京）投资咨询有限公司	<p>注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室          法定代表人：钱昊旻          联系人：沈晨          联系电话：010-59336544          客服电话：4008-909-998          公司网址：www.jnlc.com</p>
上海攀赢基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 603 室          法定代表人：沈茹意          联系人：吴卫东          联系电话：021-68889082          客服电话：021-68889082          公司网址：<a href="http://www.pytz.cn/">http://www.pytz.cn/</a></p>
五矿证券有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元          法定代表人：黄海洲          联系人：华然          联系电话：0755-82564033          客服电话：40018-40028          公司网址：<a href="https://www.wkzq.com.cn/">https://www.wkzq.com.cn/</a></p>
中国人寿保险股份有限公司	<p>注册地址：中国北京市西城区金融大街 16</p>

	号 法定代表人：王滨 联系人：秦泽伟 联系电话：010-63631539 客服电话：95519 公司网址：www.e-chinalife.com
--	---

基金管理人可根据有关法律法规规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金。

## 5.2 注册登记机构

名称：招商基金管理有限公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号  
法定代表人：刘辉  
电话：（0755）83196445  
传真：（0755）83196436  
联系人：宋宇彬

## 5.3 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所  
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼  
法定代表人（负责人）：廖海  
电话：021-51150298  
传真：021-51150398  
经办律师：刘佳、张雯倩  
联系人：刘佳

## 5.4 会计师事务所和经办注册会计师

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 0003  
经办注册会计师：汪芳、侯雯  
联系人：汪芳



## § 6 基金的募集与基金合同的生效

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露管理办法》、《业务规则》等有关法律、法规、规章及基金合同，并经中国证券监督管理委员会 2011 年 4 月 27 日证监许可（2011）605 号文核准公开募集。募集期从 2011 年 5 月 16 日起到 6 月 21 日止，共募集 605,659,802.56 份基金份额，有效认购总户数为 4,925 户。

本基金的基金合同已于 2011 年 6 月 27 日正式生效。

基金合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金财产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定的，按其规定办理。

## § 7 基金份额的申购、赎回及转换

### 7.1 申购、赎回及转换的场所

1、办理本基金的申购、赎回及转换的销售机构为基金管理人和基金管理人委托的销售代理人。

其中，直销机构为招商基金管理有限公司，代销渠道为中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司等机构。直销及代销机构请参见本招募说明书第五部分“相关服务机构”。

基金管理人可根据有关法律法规及规章规定，酌情增加或减少符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

2、投资者应当通过销售机构指定的营业场所或按销售机构提供的其他方式（如传真、电话或网上交易等形式）办理基金的申购、赎回及转换。

### 7.2 申购、赎回及转换的开放日期及办理时间

#### 1、开放日及开放时间

申购、赎回和转换的开放日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回或转换时除外）。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换的价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始日前 2 日在指定媒介上公告。

#### 3、转换业务的开始时间

本基金管理人在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。转换业务开通时间由基金管理人届时另行公告。

### 7.3 申购、赎回及转换的原则

- 1、“未知价”原则，即基金的申购、赎回和转换价格以受理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、份额赎回及转换”原则，即申购以金额申请，赎回及转换以份额申请；
- 3、当日的申购、赎回和转换申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、基金转换只适用于在同一销售机构购买的本基金管理人所管理的开通了转换业务的各基金品种之间。
- 5、本基金管理人只在转出和转入的基金均有交易的当日，方可受理投资者的转换申请。
- 6、赎回和转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即先确认的认购或申购的基金份额先赎回或先转换。
- 7、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《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。

### 7.4 申购、赎回及转换的有关限制

#### 1、基金申购的限制

原则上，投资者通过代销网点和本基金管理人官网交易平台首次申购和追加申购的最低金额均为 10 元；通过本基金管理人直销中心申购，首次最低申购金额为 50 万元人民币，追加申购单笔最低金额为 10 元人民币。实际操作中，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定。

投资者将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

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，具体请参见相关公告。

#### 2、基金赎回的限制

原则上，通过各销售机构网点赎回的，每次赎回基金份额不得低于 1 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构网点保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。实际操作中，以各代销机构的具体规定为准。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时，赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

### 3、基金转换的限制

基金转换分为转换转入和转换转出。通过各销售机构网点转换的，转出的基金份额不得低于 1 份。

通过本基金管理人电子商务网上交易平台转换的，每次转出份额不得低于 1 份。留存份额不足 1 份的，只能一次性赎回，不能进行转换。

4、投资者投资招商基金“定期定额投资计划”时，每期扣款金额最低不少于人民币 10 元。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

5、基金管理人可根据实际情况，在法律法规允许的情况下对申购金额、赎回和转换份额的数量限制进行调整，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 7.5 申购、赎回及转换的程序

1、投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回或转换的申请。

2、投资者在提交申购本基金的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回及转出申请时，帐户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申请无效而不予成交。

3、申购、赎回及转换的确认与通知：T 日在规定时间之前提交的申购、赎回及转换的申请，本基金注册登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者通常可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点或通过销售机构规定的其他方式查询申购、赎回及转换的确认情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

4、申购、赎回款项支付：基金份额投资者申购时，采用全额缴款方式，若资金未在规定的时间内全额到账则申购无效，申购无效的申购款项将退回投资者。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项将在 T+7 日内（包括该日）划入基金份额持有人账户。

5、发生延期赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

## 7.6 申购、赎回及转换的费用

本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

## 1、 申购费用

本基金的申购费按申购金额进行分档，申购费率如下表。本基金A类基金份额的申购费用应在投资人申购该类基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，费率按单笔分别计算。

A类基金份额申购费率

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%
500 万元 ≤ M < 1000 万元	0.4%
M ≥ 1000 万元	每笔 1000 元

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的基金份额持有人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

申购费用的计算方法：

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

本基金 C 类基金份额不收取申购费。

## 2、 赎回费用

本基金A类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减，费率如下：

连续持有时间 (N)	赎回费率
N < 7 天	1.5%
7 天 ≤ N < 1 年	0.5%
1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0%

(注：1年指365天，2年为730天，依此类推)

赎回费用的计算方法：赎回费用 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值 × 赎回费率

本基金A类基金份额的赎回费用由赎回该类基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对其他投资者收取的赎回费用的 75%作为注册登记费及其他相关手续费，剩余25%归基金资产所有。



本基金C类基金份额的赎回费率如下表所示：

连续持有时间（N）	赎回费率
N < 7 天	1.5%
7 天 ≤ N < 30 日	0.50%
30 日 ≤ N	0

赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取。对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

### 3、转换费用

（1）各基金间转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费两部分。

（2）每笔转换申请的转出基金端，收取转出基金的赎回费，并根据上述规定按比例归入基金财产。

（3）每笔转换申请的转入基金端，从申购费率（费用）低向高的基金转换时，收取转入基金与转出基金的申购费用差额；申购补差费用按照转入基金金额所对应的申购费率（费用）档次进行补差计算。从申购费率（费用）高向低的基金转换时，不收取申购补差费用。

（4）基金转换采取单笔计算法，投资者当日多次转换的，单笔计算转换费用。

### 4、基金管理人官网交易平台交易

www.cmfchina.com网上交易，详细费率标准或费率标准的调整请查阅官网交易平台及基金管理人公告。

5、基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整申购费率，调低赎回费率和调整收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒介公告。

6、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形下经与相关代销机构协商后根据市场情况制定基金促销计划，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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并不晚于优惠活动实施日公告。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展费率优惠活动，届时将提前公告。

## 7.7 申购份额、赎回金额的计算

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

#### 1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

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

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

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

例 1：某投资者投资 10 万元申购招商深证 TMT50ETF 联接基金 A 类基金份额，相应申购费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0160 = 96,970.63 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10 万元本金申购招商深证 TMT50ETF 联接基金 A 类基金，假定申购当日 A 类基金基金份额净值为 1.0160 元，可得到 96,970.63 份 A 类基金份额。

例 2：某投资者投资 10 万元申购招商深证 TMT50ETF 联接基金 C 类基金份额，假定申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.0160 = 98,425.19 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10 万元本金申购招商深证 TMT50ETF 联接基金 C 类基金，假定申购当日 C 类基金基金份额净值为 1.0160 元，可得到 98,425.19 份 C 类基金份额。

#### 2、基金赎回金额的计算

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

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

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

例 1：某投资者赎回 10 万份 A 类招商深证 TMT50ETF 联接基金且持有时间大于 30 日但不满 1 年，相应赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.0160 = 101,600.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 508.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 101,600.00 - 508.00 = 101,092.00 \text{ 元}$$

例 2：某投资者赎回 10 万份 C 类招商深证 TMT50ETF 联接基金，持有时间为 20 天，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.0160 = 101,600.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 508.00 \text{ 元}$$

净赎回金额=101,600.00-508.00=101,092.00 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有期限为 20 天，假设赎回当日本基金 C 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的净赎回金额为 101,092.00 元。

3、本基金申购份额的计算公式仅适用于前端收费及销售服务费模式的情况，若未来本基金开通后端收费，则本基金可以在法律法规及基金合同许可的情况下，对基金申购份额的计算方法进行调整，并在调整前 2 日在指定媒介上刊登公告。

#### 4、基金份额净值计算公式

T 日基金份额净值=T 日闭市后的该基金资产净值/T 日该基金份额的余额数量

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定进行公告。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。本基金份额净值的计算，保留到小数点后第 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

#### 5、申购份额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金财产。

#### 6、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金财产。

## 7.8 申购、赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

## 7.9 基金的定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

## 7.10 暂停或拒绝申购、赎回的情形和处理方式

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易所在交易时间非正常停市或依法决定临时停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- (3) 所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (4) 所投资的目标 ETF 暂停申购或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的；
- (5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；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且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认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- (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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- (8) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述（1）—（7）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除后，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

如果投资者的申购申请被拒绝，基金管理人应及时将申购款项退回至投资者账户。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (4) 所投资的目标 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) 所投资的目标 ETF 暂停赎回，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的；
- (6) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；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且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认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；
- (7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应按规定立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个

赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定媒介上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停赎回公告。

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，并依照有关规定在指定媒介上公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定在指定媒介上公告。

（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

（2）如果连续暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（3）如果连续暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## 7.11 巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日中，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）超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受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兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，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 10%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；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内在指定媒介上刊登公告，并同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上公告。

## § 8 基金的非交易过户、转托管、冻结和质押

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

（一）基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”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”仅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”是指司法机关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、社会团体或其他组织。

无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和基金合同规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的资料。

（二）对于符合条件的非交易过户申请按照业务规则的有关规定办理。

（三）本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照业务规则的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

（四）基金注册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注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

（五）如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## § 9 基金的投资

### 9.1 投资目标

通过主要投资于深证 TMT50ETF，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### 9.2 投资理念

随着现代信息技术的不断发展成熟，中国的 TMT 产业将进入快速发展阶段，指数化投资以其低成本、管理透明等优点，有助于投资者获得与标的指数相似的回报。

### 9.3 投资范围

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产的投资比例不高于基金资产净值的 5%。

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。

### 9.4 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：深证 TMT50 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

如果指数编制单位变更或停止深证 TMT50 指数的编制、发布或授权，或深证 TMT50 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深证 TMT50 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，或目标 ETF 标的指数发生变更，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投资者合法权益的原则，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。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。

## 9.5 风险收益特征

本基金为深证 TMT50ETF 的联接基金，属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，跟踪深证 TMT50 指数，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。

## 9.6 投资策略

本基金为深证 TMT50ETF 的联接基金，主要通过投资于深证 TMT50ETF 以求达到投资目标。本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：在正常情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

### 1、资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于一级市场新股（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产的投资比例不高于基金资产净值的 5%。

### 2、目标 ETF 投资策略

本基金对基金的投资仅限于指定的目标 ETF，目前目标 ETF 仅指深证 TMT50ETF。

#### （1）基金组合的构建

基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成目标 ETF，使本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。

#### （2）目标 ETF 的投资方式

本基金作为深证 TMT50ETF 的联接基金，投资于深证 TMT50ETF 的方式既包括在一级市场以股票篮子组合对目标 ETF 进行申购与赎回，也包括在二级市场以现金直接买卖该 ETF 份额。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以从二级市场买入 ETF 份额。本基金将综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方式。本基金在二级市场的 ETF 份额投资将不以套利为目的，只是为了追求基金的充分投资、降低与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差。

### （3）基金组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

当本基金在一级市场申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。

### 3、股票投资策略

本基金的股票投资以标的指数成份股和备选成份股的投资为主，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

### 4、债券投资策略

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

### 5、跟踪误差控制策略

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行日常的监控与管理，其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金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 0.3%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

## 9.7 投资程序

### 1、投资决策依据

- （1）须符合国家有关法律法规，严格遵守基金合同及公司章程；
- （2）维护基金份额持有人利益作为基金投资的最高准则。

### 2、投资程序

- （1）投资决策委员会定期召开会议，提出资产配置比例的指导意见；
- （2）基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案；
- （3）基金经理依据目标 ETF 基金以及目标指数成份股的名单及权重，进行投资组合构建；
- （4）基金经理及风险管理部定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；
- （5）基金经理根据基金的申购赎回等状况，适时进行投资组合调整。

在投资决策过程中，风险管理部负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

## 9.8 投资限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但国务院另有规定的和目标 ETF 除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；
- (2) 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(5) 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%；本基金管理人管理的全部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%；

(6) 基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(8) 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；

(9) 本基金不得违反基金合同关于其他投资比例的约定；

(10) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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法律法规的规定和基金合同的约定。除上述第（7）、（8）项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、目标 ETF 暂停申购赎回或二级市场停牌等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

## 9.9 目标 ETF 的变更

当出现以下情形时，基金管理人可以在履行适当的程序后变更本基金所联接的目标 ETF，以与原目标 ETF 有类似投资目标的 ETF 作为新的目标 ETF：

- 1、目标 ETF 的基金合同终止；
- 2、目标 ETF 与其他基金进行合并；
- 3、目标 ETF 变更标的指数；
- 4、目标 ETF 的基金管理人或基金托管人发生变更；
- 5、中国证监会规定的其他情形。

## 9.10 基金管理人代表基金行使股东权利或债务权利的处理原则及方法

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

## 9.11 基金投资组合报告

招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理人—招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日，来源于《招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 1 季度报告》。

### 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	6,763,946.49	2.03
	其中：股票	6,763,946.49	2.03
2	基金投资	304,747,923.95	91.44
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	19,206,975.94	5.76
8	其他资产	2,558,609.08	0.77
9	合计	333,277,455.46	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,420,228.21	1.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	1,884,339.58	0.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	248,404.00	0.08
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	210,974.70	0.06
S	综合	-	-
	合计	6,763,946.49	2.05

## 2.2 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港股通投资股票。

## 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	000063	中兴通讯	11,800	505,040.00	0.15
2	002475	立讯精密	11,200	427,392.00	0.13
3	000725	京东方 A	97,700	362,467.00	0.11
4	002415	海康威视	12,748	355,669.20	0.11
5	002230	科大讯飞	8,600	296,356.00	0.09
6	000100	TCL 科技	62,600	259,164.00	0.08
7	002027	分众传媒	56,200	248,404.00	0.08
8	300454	深信服	1,500	237,090.00	0.07
9	000977	浪潮信息	4,772	185,058.16	0.06
10	002555	三七互娱	5,217	170,387.22	0.05

#### 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名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名的前十名资产支持证券投资 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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 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 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	招商深证 TMT50ETF	股票型	交易型开 放式	招商基金管 理有限公司	304,747,923.95	92.38

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 12 投资组合报告附注

### 12.1



报告期内基金投资的前十名证券除科大讯飞（证券代码 002230）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。

根据 2019 年 7 月 1 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被工业和信息化部责令改正。

根据 2019 年 8 月 16 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被国家税务总局合肥高新技术产业开发区税务局责令改正。

根据 2019 年 12 月 10 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被中华人民共和国工业和信息化部网络安全管理局责令改正。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

## 12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

## 12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	194,075.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,388.46
5	应收申购款	2,360,145.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,558,609.08

## 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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 10 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人不能保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

招商深证 TMT50ETF 联接 A：

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
2011.06.27-2011.12.31	-27.30%	1.45%	-24.93%	1.56%	-2.37%	-0.11%
2012.01.01-2012.12.31	2.34%	1.41%	2.13%	1.40%	0.21%	0.01%
2013.01.01-2013.12.31	47.98%	1.67%	48.00%	1.62%	-0.02%	0.05%
2014.01.01-2014.12.31	9.26%	1.26%	10.34%	1.24%	-1.08%	0.02%
2015.01.01-2015.12.31	50.12%	3.24%	56.20%	2.82%	-6.08%	0.42%
2016.01.01-2016.12.31	-24.75%	2.03%	-23.94%	1.83%	-0.81%	0.20%
2017.01.01-2017.12.31	15.89%	1.07%	20.35%	1.09%	-4.46%	-0.02%
2018.01.01-2018.12.31	-39.57%	1.82%	-39.89%	1.84%	0.32%	-0.02%
2019.01.01-2019.12.31	58.10%	1.79%	59.44%	1.82%	-1.34%	-0.03%
2020.01.01-2020.03.31	-2.85%	2.89%	-2.38%	2.90%	-0.47%	-0.01%
自基金成立起至 2020.03.31	46.19%	1.90%	67.48%	1.81%	-21.29%	0.09%

注：本基金合同生效日为 2011 年 6 月 27 日。

招商深证 TMT50ETF 联接 C：

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
2017.08.18-2017.12.31	4.24%	1.22%	6.03%	1.23%	-1.79%	-0.01%
2018.01.01-2018.12.31	-39.77%	1.81%	-39.89%	1.84%	0.12%	-0.03%
2019.01.01-2019.12.31	57.47%	1.79%	59.44%	1.82%	-1.97%	-0.03%
2020.01.01-2020.03.31	-2.95%	2.89%	-2.38%	2.90%	-0.57%	-0.01%
自基金成立起至 2020.03.31	-4.05%	1.86%	-0.81%	1.89%	-3.24%	-0.03%

注：本基金自 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 8 月 18 日起存续。

## § 11 基金的财产

### 11.1 基金财产的构成

基金资产总值是指本基金拥有的包括目标 ETF 份额在内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。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、目标 ETF、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### 11.2 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价值。

### 11.3 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。

### 11.4 基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人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。除法律法规和基金合同、托管协议的规定处分外，基金财产不得被处分。

4、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范围。

5、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## § 12 基金资产的估值

### 12.1 估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 12.2 估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 12.3 估值对象

基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### 12.4 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，以双方认可的方式发送给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 12.5 估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、目标 ETF 估值方法：

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值，如该日目标 ETF 未公布净值，则按目标 ETF 最近公布的净值估值。

#### 2、证券交易所上市的有价证券的估值：

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等，不包括本基金所投资的目标 ETF），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、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

生了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，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化、证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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，确定公允价格；

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

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

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

6、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7、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。

8、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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基



础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 12.6 基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的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份额净值予以公布。

基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 12.7 暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、基金所投资之目标 ETF 发生暂停估值，暂停公告基金份额净值的情形；
- 3、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 4、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且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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 5、法律法规、中国证监会认定的其他情形。

## 12.8 估值错误的处理

当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

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财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

- 1、差错类型

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

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

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

## 2、差错处理原则

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

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责

任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构的交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

## 12.9 特殊情形的处理

基金管理人按估值方法的第 7 条进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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，致使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、基金托管人可以免除相应赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## § 13 基金的收益与分配

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 收益分配原则

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；
- 2、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 4、A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于 A 类基金份额不收取而 C 类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 5、基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 13.4 收益分配方案

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

### 13.5 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。

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）的时间不超过 15 个工作日。

### 13.6 收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## § 14 基金的费用与税收

### 14.1 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 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和律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 14.2 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理费

本基金基金财产中目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提基金管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.5\% \div \text{当年天数}, 0)$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

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一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管费

本基金基金财产中目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.1\% \div \text{当年天数}, 0)$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的基金资产净值

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一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、上述“14.1 基金费用的种类”中第 4—9 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。

## 14.3 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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。

## 14.4 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 日在指定媒介上公告并报中国证监会备案。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

## 14.5 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。



## § 15 基金的会计与审计

### 15.1 基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行；

4、本基金独立建账、独立核算；

5、本基金会计责任人为基金管理人；

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法規规定编制基金会计报表，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。

### 15.2 基金审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；

3、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。

## § 16 基金的信息披露

16.1 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

### 16.2 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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

16.3 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、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

16.4 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不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，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。

16.5 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 16.6 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报刊和网站上。

## 16.7 合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介和网站上登载基金合同生效公告。

## 16.8 基金净值信息

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财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，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、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，在指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。

## 16.9 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额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“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 16.10 临时报告与公告

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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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事件，包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、变更目标 ETF；
- 5、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 6、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 7、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 9、基金募集期延长或提前结束募集；

10、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

11、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

14、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事项，中国证监会另有规定的情形除外；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值 0.5%；

18、基金开始办理申购、赎回；

19、基金发生巨额赎回并延期办理；

20、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 16.11 澄清公告

在基金合同期限内，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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

## 16.12 清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并制作清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

### 16.13 信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

## § 17 风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本基金为深证 TMT50ETF 的联接基金，属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，跟踪深证 TMT50 指数，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。面临的主要风险有市场风险、标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、流动性风险、管理风险及其他风险等。本基金适合具有较高风险承受能力、并能正确认识和对待本基金可能出现的投资风险的中长期投资者。

基金管理人建议基金投资者在选择本基金之前，通过正规的途径，如：招商基金客户服务热线（4008879555），招商基金公司网站（www.cmfcchina.com）或者通过其他代销机构，对本基金进行充分、详细的了解。在对自己的资金状况、投资期限、收益预期和风险承受能力做出客观合理的评估后，再做出是否投资的决定。投资者应确保在投资本基金后，即使出现短期的亏损也不会给自己的正常生活带来很大的影响。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金管理人提请投资者特别注意，因基金份额拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益

。因基金份额拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值仍有可能低于初始面值。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩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，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

## 17.1 证券市场风险

证券市场受各种因素的影响所引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险。引起市场风险的主要因素有：

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、再投资风险：市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

## 17.2 本基金特有的投资风险

1、TMT 行业投资的风险：本基金的主要投资方向是与电子信息相关的新兴技术产业，该产业受国家政策影响较大，国家产业政策的变化可能导致行业投资环境发生变化。同时，TMT 行业中的中小型上市公司相对较多，与一些传统行业的大型上市公司相比，其流动性可能相对较弱，波动性可能相对较大一些。

### 2、目标 ETF 的风险

本基金属于 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金为目标 ETF 的联接基金，但是本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与目标 ETF 并不完全相同，不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致。

### 3、标的指数的风险

（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险



标的指数并不能完全代表相应股票市场，标的指数成份股的平均回报率与相应股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### （2）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （3）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。

### 4、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

（1）本基金 90%以上的净资产投资于目标 ETF，目标 ETF 回报与标的指数回报的偏离会造成本基金与标的指数的跟踪偏离；

（2）本基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致本基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度；

（3）受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标 ETF 份额和指数成份股、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将目标 ETF 份额和指数成份股及时地转化为现金，使得本基金在跟踪标的指数时存在一定的跟踪偏离风险。

## 17.3 流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“§7 基金份额的申购、赎回及转换”章节。

#### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为深证 TMT50ETF，同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

#### 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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

## 17.4 管理风险

在基金管理运作过程中，管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

## 17.5 其他风险

### 1、操作风险

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

### 2、技术风险

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

### 3、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金资产的损失。

### 4、不可抗力

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

## § 18 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 18.1 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### 18.2 基金合同的终止

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；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

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、从基金财产中获得补偿的权利。

### 18.3 基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算小组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算小组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 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、期货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。

### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行评估和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

### 4、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。

### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

### 6、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具有证券、期货相关业务资格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合同终止并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。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## § 19 基金合同的内容摘要

### 19.1 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- (10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (13) 代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利，基金合同另有约定的除外；
- (14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经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；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议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；

(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净值信息，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；

(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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供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。

### 3、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 4、基金托管人的义务

（1）安全保管基金财产；

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

（3）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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



- (5) 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和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核基金管理人计算的基金净值信息；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

#### 5、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 出席或者委派代表出席目标 ETF 份额持有人大会，对目标 ETF 份额持有人大会审议事项行使表决权，参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标 ETF 份额占本基金资产的比例折算；

(10) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 6、基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

(2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

(5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 19.2 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、有以下情形之一时，应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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准以及基金销售服务费率；

(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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(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) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会；

(12) 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；

(13) 对基金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。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

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

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式；

(4) 调整基金份额类别设置、分类办法和规则；

(5) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或者注册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；

(6) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(7) 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；

(8) 基金管理人、相关证券交易所和注册登记机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

(9) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集或在规定时间内未能作出书面答复，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

（4）代表基金份额 10%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，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，代表基金份额 10%以上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。

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

（6）基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## 5、通知

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、方式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （4）会务常设联系人姓名、电话；
- （5）权益登记日；

（6）如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的表决意见以书面形式或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

(4) 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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果出现任何不符合上述基金份额持有人大会召开条件的情况，则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为 30 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件，才能视为有效。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

a、议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

b、基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案，也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人。

c、对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

d、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

e、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）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人按照前述约定公布提案，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。

## 8、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### a、特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

### b、一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当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，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具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。

## 9、计票

### （1）现场开会

a、基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

b、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。

c、如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

d、在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

e、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）通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式可采取如下方式：

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。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人。

## 10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

## 11、本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面的联系

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 的份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，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所持有的目标 ETF 份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 份额持有人大会。

12、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 19.3 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本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。



(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

## 2、基金合同的终止

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；

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

(3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

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、从基金财产中获得补偿的权利。

## 3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算小组对基金财产进行清算。

### (2) 基金财产清算小组

a、自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

b、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、期货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。

c、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。

### (3) 清算程序

a、基金合同终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

b、基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；

c、对基金财产进行评估和变现；

d、制作清算报告；

e、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；

f、将清算报告报中国证监会备案并公告；

g、对基金财产进行分配。

(4) 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。

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

a、支付清算费用；

b、交纳所欠税款；

c、清偿基金债务；

d、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 a、b、c 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(6) 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具有证券、期货相关业务资格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合同终止并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。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 19.4 争议解决方式

1、基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

## 19.5 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## § 20 基金托管协议的内容摘要

### 20.1 托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：招商基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：刘辉

设立日期：2002 年 12 月 27 日

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002]100 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：13.1 亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及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、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国

外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

## 20.2 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

### 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产的投资比例不高于基金资产净值的 5%。

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。

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

### 2、对基金投融资比例进行监督；

#### （1）按法律法规的规定及基金合同的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，其中投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于一级市场新发股票（包括主板市场、中小板市场和创业板市场的股票）、债券、权证、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产的投资比例不高于基金资产净值的 5%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

#### （2）根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；

b、本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

c、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

d、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

e、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%；本基金管理人管理的全部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%；

f、基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

g、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

h、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；本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

i、本基金不得违反基金合同关于其他投资比例的约定；

j、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

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法律法规的规定和基金合同的约定。除上述第 g、h 项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、目标 ETF 暂停申购赎回或二级市场停牌等基金管理人之外的原因导致的投资组

合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

（5）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3、对基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但国务院另有规定的和目标 ETF 除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应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；若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

4、基金管理人向基金托管人及时提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，对交易对手库予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，

应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

B、基金托管人应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复核。

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

D、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

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

### 20.3 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托



管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

## 20.4 基金财产的保管

### 1、基金财产保管的原则

- (1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- (2) 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- (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) 除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### 2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

- (1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。
- (2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

- (1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- (2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- (3) 本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- (4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

### 4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

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

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

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

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

#### 6、债券托管专户的开设和管理

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

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

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

#### 8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## 20.5 基金资产净值计算和会计核算

## 1、基金资产净值的计算和复核

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（2）基金管理人应每交易日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个交易日结束后计算当日的该基金份额资产净值，并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

（3）当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）除《基金合同》和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人及基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

（7）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可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### (2) 会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应每月就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### (3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 20.6 基金份额持有人名册的保管

### 1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

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

### 2、基金份额持有人名册的提供

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

### 3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

## 20.7 适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## § 21 对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺向基金份额持有人提供下列服务。同时，基金管理人有权根据投资人的需要和市场的变化，对以下服务内容进行相应调整。

### 21.1 网上开户与交易服务

客户持有指定银行的账户，通过招商基金网上交易平台，可以实现在线开户交易。

招商基金网址：[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)

### 21.2 资料的寄送服务

1、本基金管理人将按照份额持有人的定制情况，提供纸质、电子邮件或短信方式对账单。客户可通过招商基金客户服务热线或者网站进行账单服务定制或更改。服务费用由本基金管理人承担，客户无需额外承担费用。

2、由于交易对账单记录信息属于个人隐私，如果客户选择邮寄方式，请务必预留正确的通讯地址及联系方式，并及时进行更新。本基金管理人提供的资料邮寄服务原则上采用邮政平信邮寄方式，并不对邮寄资料的送达做出承诺和保证；也不对因邮寄资料出现遗漏、泄露而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

3、电子邮件对账单经互联网传送，可能因邮件服务器解析等问题无法正常显示原发送内容，也无法完全保证其安全性与及时性。因此招商基金管理公司不对电子邮件或短信息电子化账单的送达做出承诺和保证，也不对因互联网或通讯等原因造成的信息不完整、泄露等而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

4、根据客户的需求，本基金管理人可提供如资产证明书等其它形式的账户信息资料。

### 21.3 信息发送服务

基金份额持有人可以通过招商基金管理公司网站、客户服务热线提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯或 E-MAIL 方式发送基金份额持有人定制的信息。可定制的信息包括：基金净值、投研观点、公司最新公告提示等，基金公司还将根据业务发展的实际需要，适时调整定制信息的内容。

除了发送基金份额持有人定制的各类信息外，基金公司也会定期或不定期向预留手机号码及 EMAIL 地址的基金份额持有人发送基金分红、节日问候、产品推广等信息。如基金份额持有人不希望接收到该类信息，可以通过招商基金客户服务热线取消该项服务。

## 21.4 网络在线服务

基金份额持有人通过基金账号/开户证件号码及登录密码登录招商基金网站，可享有账户查询、信息定制、资料修改、理财刊物查阅等多项在线服务。

招商基金网址：[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)

招商基金电子邮箱：[cmf@cmfchina.com](mailto:cmf@cmfchina.com)

## 21.5 招商基金客服热线电话服务

招商基金客户服务热线提供全天候 24 小时的自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、交易情况、基金份额净值等信息的查询。

招商基金客户服务热线提供每周六天（法定节假日除外），每天不少于 7 小时的人工咨询服务。基金份额持有人可通过该热线享受业务咨询、信息查询、信息服务定制、资料修改、投诉建议等专项服务。

招商基金全国统一客户服务热线： 400-887-9555（免长途话费）

## 21.6 客户投诉受理服务

基金份额持有人可以通过直销和代销机构网点柜台的意见簿、基金公司网站、客户服务热线、书信及电子邮件等不同的渠道对基金公司和销售网点提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复，对于不能及时回复的投诉，基金公司将在承诺的时限内进行处理。对于非工作日提出的投诉，将在顺延的工作日当日进行处理。

## § 22 其他应披露事项

序号	公告事项	公告日期
1	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 2 季度报告	2019-07-19
2	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券费率优惠活动的公告	2019-07-23
3	招商基金旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-07-26
4	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与银河证券费率优惠活动的公告	2019-08-05
5	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（二零一九年第二号）	2019-08-09
6	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要（二零一九年第二号）	2019-08-09
7	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年半年度报告	2019-08-26
8	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年半年度报告摘要	2019-08-26
9	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加上海陆亨基金销售有限公司为销售机构的公告	2019-09-09
10	招商基金管理有限公司关于注意防范冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示性公告	2019-09-27
11	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	2019-09-30
12	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加联储证券为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-10-11
13	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加天天基金为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-10-17
14	招商基金管理有限公司旗下部分基金参与上海陆亨基金销售有限公司费率（含定投）优惠活动的公告	2019-10-21
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	2019-10-24
16	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 3 季度报告	2019-10-24
17	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2019-10-31
18	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	2019-12-05
19	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	2019-12-11
20	招商基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	2019-12-13
21	关于招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更的公告	2020-01-02
22	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金	2020-01-11



	联接基金更新的招募说明书摘要（二零二零年第一号）	
23	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（二零二零年第一号）	2020-01-11
24	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加微众银行为销售机构的公告	2020-01-17
25	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 4 季度报告	2020-01-18
26	招商基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	2020-01-18
27	招商基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	2020-01-29
28	招商基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金的公告	2020-02-05
29	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加五矿证券为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-02-20
30	招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议（2020 年 2 月 25 日修订）	2020-02-25
31	招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同（2020 年 2 月 25 日修订）	2020-02-25
32	招商基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同信息披露有关条款的公告	2020-02-25
33	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书（二零二零年第二号）	2020-02-28
34	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新的招募说明书摘要（二零二零年第二号）	2020-02-28
35	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-03-13
36	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	2020-03-13
37	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中信期货有限公司为销售机构的公告	2020-03-26
38	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年年度报告	2020-03-31
39	招商基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	2020-03-31
40	招商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	2020-04-21
41	招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 年第 1 季度报告	2020-04-21
42	关于招商基金管理有限公司旗下部分基金增加汇成基金为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-05-06
43	招商基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	2020-05-07
44	招商基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	2020-05-09
45	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2020-05-12
46	招商基金管理有限公司关于调整旗下相关基金定期定额申购业务最低申购金额的公告	2020-06-03

## § 23 招募说明书存放及其查阅方式

### 23.1 《招募说明书》的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的住所，并刊登在基金管理人的网站上。

。

### 23.2 《招募说明书》的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

## § 24 备查文件

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

- 1、中国证监会批准招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件
- 2、《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、《招商深证电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金代销协议》
- 5、法律意见书
- 6、招商基金管理有限公司业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、中国银行股份有限公司业务资格批件和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

招商基金管理有限公司  
2020年6月23日