

招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的 招募说明书（二零二六年第一号）

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：2026 年 1 月 21 日

重要提示

招商央视财经 50 指数证券投资基金 (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 2012 年 10 月 8 日《关于核准招商央视财经 50 指数证券投资基金募集的批复》(证监许可〔2012〕1309 号) 核准公开募集。本基金的基金合同于 2013 年 2 月 5 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。

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。当投资人赎回时, 所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。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。投资人在认购 (或申购) 本基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金的投资范围包括存托凭证, 可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险, 以及与存托凭证发行机制相关的风险。

本基金的投资范围包括债券回购, 债券回购为提升基金组合收益提供了可能, 但也存在一定的风险。如发生债券回购交收违约, 质押券可能面临被处置的风险, 因处置价格、数量、时间等的不确定, 可能会给基金资产造成损失。投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本基金。

基金份额持有人投资于本基金的资金应当来源合法, 不得利用本基金开展洗钱、恐怖融资等违法犯罪活动。联合国及中国政府制定或认可的制裁名单内的企业、组织或个人, 以及位于联合国及中国政府制定或认可的制裁的国家和地区的企业、组织或个人, 不得投资于本基金。

本基金标的指数为央视财经 50 指数。

(1) 样本股选样方法

截至当年 4 月 30 日已披露上一个会计年度年报的上市公司 A 股, 在进行基础财务指标等条件的初步筛选后, 按照如下规则确定样本:

1. 维度评分排名

由央视财经频道联合五大高校, 即北京大学、中央财经大学、复旦大学、南开大学以及中国人民大学 (根据维度排序), 分别从“创新、成长、回报、治理、责任”五个维度设计指标评价体系。根据该评价体系, 从五个维度对上市公司评分与排名。从每个维度选择排名靠前的上市公司作为备选样本。

2. 样本股确定

由指数专家委员会与多家市场投研机构分别对备选样本股进行评价。结合两者的评价结果, 由中国上市公司协会、中国注册会计师协会与大公国际资信评估公司, 从公司合规性、财务状况与资信评级三种角度进行评定, 最终确定每个维度 10 家、合计 50 家上市公司作为央视财经 50 指数样本股。若同一家公司同时入选多个维度, 选择公司排名靠前的维度入选。

在各维度未能入选的备选样本股中, 分别选取排名靠前的 5 家公司作为各维度的候补样本股。

有关标的指数具体编制方案及成份券信息详见深圳证券信息有限公司网站, 网址: www.cnindex.com.cn。

本次更新招募说明书所载内容截止日为 2026 年 1 月 21 日, 有关财务和业绩表现数据截止日为 2025 年 12 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	10
§4 基金托管人	20
§5 相关服务机构	22
§6 基金的募集与基金合同的生效	24
§7 基金份额的申购、赎回及转换	25
§8 基金的投资	35
§9 基金的业绩	47
§10 基金的财产	49
§11 基金资产的估值	50
§12 基金的收益分配	54
§13 基金的费用与税收	56
§14 基金份额的注册登记、非交易过户、转托管、冻结与解冻	59
§15 基金的会计和审计	61
§16 基金的信息披露	62
§17 风险揭示与管理	67
§18 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	73
§19 基金合同的内容摘要	75
§20 基金托管协议的内容摘要	91
§21 对基金份额持有人的服务	101
§22 其他应披露事项	103
§23 招募说明书的存放及查阅方式	105
§24 备查文件	106

§ 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《招商央视财经 50 指数证券投资基金基金合同》(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。**基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。**基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

§ 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	指招商央视财经 50 指数证券投资基金
基金管理人	指招商基金管理有限公司
基金托管人	指中国银行股份有限公司
基金合同	指《招商央视财经 50 指数证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效的修订和补充
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《招商央视财经 50 指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
招募说明书	指《招商央视财经 50 指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
基金份额发售公告	指《招商央视财经 50 指数证券投资基金基金份额发售公告》
法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
《基金法》	指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《信息披露办法》	中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》	指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《流动性规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
《指数基金指引》	指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构	指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
基金合同当事人	指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

机构投资者	指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
投资人	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金销售业务	指基金管理人或销售机构宣传推介基金, 发售基金份额, 办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构	指招商基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件, 取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议, 代为办理基金销售业务的机构
登记业务	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务, 具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
登记机构	指办理登记业务的机构。基金的登记机构为招商基金管理有限公司或接受招商基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
基金账户	指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户
基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件, 基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕, 并获得中国证监会书面确认的日期
基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后, 基金财产清算完毕, 清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
基金募集期	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间, 最长不得超过 3 个月
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)
开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
开放时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

《业务规则》	指《招商基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
认购	指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
申购	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
赎回	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
基金转换	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
转托管	指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
定期定额投资计划	指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
巨额赎回	指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%
元	指人民币元
标的指数	央视财经 50 指数
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
基金资产总值	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
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
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力	指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

§ 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: 王颖

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。目前公司注册资本为人民币十三亿一千万 (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, 公司注册资本由人民币一亿六千万元增加至人民币二亿一千万。

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, 公司注册资本金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

王颖女士, 南京大学政治经济学专业硕士。1997 年 1 月加入招商银行, 历任招商银行北京分行行长助理、副行长, 天津分行行长, 深圳分行行长, 招商银行行长助理。2023 年 11 月起任招商银行副行长。兼任中国银联股份有限公司董事、招商信诺人寿保险有限公司董事长。现任公司董事长。

李俐女士, 北京大学世界经济学硕士。1994 年 7 月加入招商银行, 曾任总行统计信息中心副主任、计划财务部副总经理、资产负债管理部副总经理、全面风险管理办公室副总经理兼操作风险管理部总经理、风险管理部副总经理、财务会计部副总经理、财务会计部总经理, 兼任采购管理部总经理等职务。2023 年 11 月起任招商银行总行资产负债管理部总经理 (2024 年 6 月起兼任投资管理部总经理、境外分行管理部总经理)。兼任招商永隆银行有限公司董事、招银金融租赁有限公司董事、招银国际金融控股有限公司董事、招银国际金融有限公司董事、招联消费金融股份有限公司董事、招商信诺人寿保险有限公司董事。现任公司董事。

缪新琼先生, 武汉大学金融学硕士。2004 年 7 月加入招商证券, 曾任青岛即墨市蓝鳌路证券营业部负责人、深圳益田路免税商务大厦证券营业部副总经理、深圳深南大道车公庙

证券营业部负责人、财富管理及机构业务总部机构业务部负责人。2022 年 12 月至 2025 年 3 月任招商证券财富管理及机构业务总部财富管理部负责人 (其中, 2024 年 6 月至 2025 年 3 月兼任财富管理及机构业务总部机构业务部负责人)。2025 年 3 月起任招商证券财富管理及机构业务总部机构业务部负责人。现任公司董事。

钟文岳先生, 厦门大学经济学硕士。曾在中农信福建集团公司、申银万国证券股份有限公司、厦门海发投资实业股份有限公司、二十一世纪科技投资有限责任公司、新江南投资有限公司、招商银行股份有限公司工作。2015 年 6 月至 2023 年 6 月在招商基金管理有限公司工作, 曾任公司党委副书记、常务副总经理、财务负责人、深圳分公司及成都分公司总经理。2023 年 7 月至 2025 年 5 月在招银理财有限责任公司工作, 曾任党委副书记、总裁。2025 年 5 月加入招商基金管理有限公司, 任公司党委副书记、董事、总经理。2025 年 7 月起任公司党委书记、董事、总经理。

张思宁女士, 中国人民银行金融研究所金融学博士研究生。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。兼任百联集团有限公司外部董事。现任公司独立董事。

陈宏民先生, 上海交通大学工学博士研究生。1982 年 9 月至 1985 年 9 月担任上海新联纺织品进出口公司职工大学教师。1991 年 3 月加入上海交通大学安泰经济与管理学院, 历任讲师、副教授、教授, 系主任、研究所所长、副院长。1993 年 4 月至 1994 年 6 月于加拿大不列颠哥伦比亚大学作博士后研究。2009 年 2 月至 2015 年 3 月兼任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司独立董事。1994 年 12 月起任上海交通大学安泰经管学院教授, 兼任上海交通大学行业研究院副院长、中国管理科学与工程学会副理事长、上海市人民政府参事、《系统管理学报》杂志主编、上海唯赛勃环保科技股份有限公司独立董事。现任公司独立董事。

梁上坤先生, 南京大学会计学博士研究生。2013 年 7 月起在中央财经大学工作, 曾任讲师、副教授、教授。现任中央财经大学科研处副处长, 兼任常州百瑞吉生物医药股份有限公司独立董事、上海同达创业投资股份有限公司独立董事。现任公司独立董事。

3.2.2 公司高级管理人员

钟文岳先生, 总经理, 简历同上。

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及博时基金（国际）有限公司董事。

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。

谭智勇先生，副总经理，工商管理硕士、国际贸易学硕士。2004 年 7 月至 2025 年 7 月曾在招商银行股份有限公司、招商信诺人寿保险有限公司工作。2025 年 7 月加入招商基金管理有限公司，现任公司副总经理。

孙明霞女士，副总经理，工学硕士。曾在人力资源和社会保障部工作，2016 年 6 月加入招商基金管理有限公司任总经理助理，现任招商基金管理有限公司党委委员、副总经理、财务负责人、养老金融业务总部总监，兼任招商财富资产管理有限公司董事。

王景女士，公司首席（副总经理级），产业经济学硕士。1991 年 8 月至 2010 年 8 月曾在中国石油乌鲁木齐石化公司物资装备公司、北京许继电气有限公司、中绿实业有限公司、金鹰基金管理有限公司、中信基金管理有限责任公司、华夏基金管理有限公司、东兴证券股份有限公司工作。2010 年 8 月加入招商基金管理有限公司，曾任固定收益投资部基金经理，投资管理三部基金经理、副总监，投资管理一部副总监（主持工作）、总监，公司总经理助理，现任公司首席（副总经理级）。

李刚先生，公司首席（副总经理级），经济学博士。2002 年 4 月至 2025 年 4 月曾在中国农业银行股份有限公司、鹏扬基金管理有限公司、惠升基金管理有限责任公司工作。2025 年 5 月加入招商基金管理有限公司，现任公司首席（副总经理级）。

朱红裕先生，公司首席（副总经理级），化学工程与技术硕士。2005 年 8 月至 2021 年 5 月曾在华夏证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、银河基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司、红杉资本中国基金、上海弘尚资产管理中心（有限合伙）、招银理财有限责任公司工作。2021 年 5 月加入招商基金管理有限公司任首席研究官，现任公司首席（副总经理级）兼投资管理四部总监。

陈方元先生，公司首席（副总经理级），工商管理硕士。2004 年 7 月至 2007 年 4 月在北京甲骨文软件系统有限公司上海办事处工作，2010 年 4 月至 2015 年 6 月在国泰基金管理有限公司工作。2015 年 7 月加入招商基金管理有限公司，曾任战略客户部总监、机构资产管理部总监、机构业务总监、公司首席机构业务官，现任公司首席（副总经理级）兼机构业务总部总监。

于立勇先生，公司首席（副总经理级），管理科学与工程博士。2004 年 8 月至 2022 年 3 月曾在中国人保资产管理有限公司工作。2022 年 3 月加入招商基金管理有限公司，曾任公司首席配置官兼投资管理四部总监，现任公司首席（副总经理级）。

3.2.3 基金经理

廖裕舟先生，硕士，2016 年 7 月至 2016 年 10 月在创金合信基金管理有限公司工作，任监察稽核部风控专员；2016 年 10 月至 2021 年 9 月在融通基金管理有限公司工作，任指数与量化投资部量化研究员；2021 年 9 月至 2022 年 3 月在安信证券股份有限公司工作，任零售业务委员会基金研究岗；2022 年 3 月至 2025 年 4 月在申万菱信基金管理有限公司工作，任指数投资部基金经理；2025 年 4 月加入招商基金管理有限公司，现任招商中证沪港深 500 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 11 月 13 日至今）、招商中证新能源汽车指数型证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 11 月 13 日至今）、招商中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 11 月 13 日至今）、招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 11 月 13 日至今）、招商央视财经 50 指数证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 11 月 13 日至今）、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（管理时间：2025 年 12 月 11 日至今）、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金基金经理（管理时间：2025 年 12 月 25 日至今）。

本基金历任基金经理包括：王平先生，管理时间为 2013 年 2 月 5 日至 2016 年 12 月 3 日；陈剑波先生，管理时间为 2016 年 12 月 3 日至 2017 年 9 月 5 日；侯昊先生，管理时间为 2017 年 9 月 5 日至 2025 年 11 月 13 日。

3.2.4 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：钟文岳、王景、李刚、朱红裕、于立勇。

钟文岳先生，简历同上。

王景女士，简历同上。

李刚先生，简历同上。

朱红裕先生，简历同上。

于立勇先生，简历同上。

3.2.5 上述人员之间均不存在近亲属关系。

3.3 基金管理人职责

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、编制中期和年度基金报告;
- 7、计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回及转换价格;
- 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《中华人民共和国证券法》、《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, 但是法律法规或监管部门另有规定的除外;
- (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。

上述禁止行为为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关禁止性规定,如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金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) 泄露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) 不泄露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) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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览, 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、岗位责任进行了规范。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。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：人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

法定代表人：葛海蛟

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

中国银行资产托管部设立于 1998 年，现有员工 120 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 2025 年 12 月 31 日，中国银行已托管 1200 只证券投资基金，其中境内基金 1131 只，QDII 基金 69 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 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

中国银行托管业务风险管理与内部控制纳入中国银行全面风险管理体系。资产托管部作为一道防线部门, 承担托管业务风险控制的第一责任; 风险管理部门作为第二道防线部门, 承担制定风险管理制度和流程, 监测和管理风险的责任, 对托管业务进行指导、培训、监督检查; 审计部门作为第三道防线, 负责开展托管业务审计工作, 发现问题, 揭示风险, 提出审计建议。中国银行托管业务风险控制贯穿业务各环节, 通过制度建设与执行、风险与控制评估、内外部检查及审计监督等措施, 持续完善托管业务全员、全面、全程的风险管理体系。

2007 年起, 中国银行开始聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作, 已连续多年获得基于“ISAE3402”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的内控鉴证报告。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 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

招商基金官网交易平台

交易网站: www.cmfcchina.com

客服电话: 400-887-9555

电话: (0755) 83076995

传真: (0755) 83199059

联系人: 李璟

招商基金直销交易服务联系方式

地址: 广东省深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 7 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

本基金代销机构信息请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规规定调整销售机构,并在基金管理人网站公示。

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: 王颖

电话: (0755) 83196445

传真: (0755) 83196436

联系人: 宋宇彬

名称: 中国证券登记结算有限责任公司
住所: 北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人: 于文强
电话: (010) 50938782
传真: (010) 50938991
联系人: 赵亦清

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
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: 毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册地址: 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
执行事务合伙人: 邹俊
电话: (0755) 2547 1000
传真: (0755) 2547 3366
经办注册会计师: 叶云晖 刘西茜 柳育慈
联系人: 蔡正轩

§ 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证监许可[2012]1309号文核准公开募集。募集期从2013年1月10日起到2013年1月31日止,共募集1,319,259,082.36份基金份额,有效认购总户数为4,832户。

本基金的基金合同已于2013年2月5日正式生效。

基金合同生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,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并报送解决方案。法律法规另有规定时,从其规定。

§ 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

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、招商证券股份有限公司等。具体代销渠道名单以份额发售公告为准。直销及代销机构请参见本招募说明书“相关服务机构”。

基金管理人可根据有关法律法规的规定,酌情增加或减少符合要求的机构代理销售本基金。新增加的代销机构将另行公告。

销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

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证券交易场所的交易日,以上海、深圳证券交易所为主,基金管理人公告暂停申购、赎回或转换时除外。具体业务办理时间由基金管理人与代销机构约定,每交易日交易时间以后提交的申请,按下一交易日的业务申请处理。

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

投资人在开放日之外的日期和时间提出申购、赎回及转换申请的,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

本基金的日常申购、赎回自基金合同生效后不超过三个月开始办理,具体业务办理时间在申购、赎回开始的公告中规定。在确定申购开始、赎回开始的时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前 2 日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

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，即申购、赎回及转换价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回及转换以份额申请；

3、赎回遵循“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；

4、当日的申购、赎回及转换申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，基金投资者交付款项后，申购申请方为有效；

6、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；

7、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；

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体及基金管理人网站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 1 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，投资人需遵循销售机构的相关规定。

投资人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。

2、基金赎回的限制

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。

通过本基金管理人电子商务网上交易平台赎回，每次赎回份额不得低于 1 份。

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。基金持有人转换时或转换后账户中基金份额低于 1 份时一次性转出。

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、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。

6、基金管理人可根据有关法律法规和市场情况，调整申购金额、赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告。

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或赎回的申请。

2、基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回及转出申请时须持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：基金管理人应以交易时间结束前收到申购、赎回及转换申请的当日作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，基金投资者可在 T+2 日（包括该日）后到销售机构网点或以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。

基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销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的确认结果为准。

4、申购、赎回款项支付：申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。

在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

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,申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购,费率按单笔分别计算。费率如下:

A 类基金份额申购费:

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	每笔 500 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:

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

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

申购费用以人民币元为单位,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。

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 < 365 天	0.5%
365 天 ≤ N < 730 天	0.25%
N ≥ 730 天	0%

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

赎回费用以人民币元为单位,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。

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 天的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持有期大于或者等于 7 天的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产,其余用于支付注册登记费和他必要的手续费。

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 天	0.5%
30 天 ≤ 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 类基金份额持有人投资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、基金管理人可以在履行相关手续后, 在基金合同约定的范围内调整申购费率、调低赎回费率或调整收费方式, 基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

6、对特定交易方式 (如网上交易、电话交易等), 基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划, 针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后, 对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率, 并不晚于优惠活动实施日公告。

8、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, 详见基金管理人发布的相关公告。

7.7 申购份额、赎回金额的计算

本基金各类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同, 本基金各类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

1、申购份额的计算方式: 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后除以申请当日基金份额净值, 有效份额单位为份, 申购份额的计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位开始舍去, 舍去部分归基金财产。

1) 申购费用适用比例费率时, 申购份额的计算方法如下:

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

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

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

2) 申购费用为固定金额时, 申购份数的计算方法如下:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例 1: 某投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额, 相应申购费率为 1.2%, 假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.016 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.016 = 97,258.10 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额, 假定申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.016 元, 可得到 97,258.10 份 A 类基金份额。

例 2: 某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额, 假定申购当日 C 类基金份额净值为 1.016 元, 则可得到的申购份额为:

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.016 = 98,425.19 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额, 假定申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.016 元, 可得到 98,425.19 份 C 类基金份额。

2、赎回金额的计算方式: 赎回总额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额, 赎回金额为赎回总额扣除赎回费用的金额, 计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位开始舍去, 舍去部分归基金财产。

基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用, 其中:

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

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

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

例 1: 某投资者赎回 10 万份本基金 A 类基金份额且持有时间不满 365 天, 相应赎回费率为 0.5%, 假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.016 元, 则其可得到的净赎回金额为:

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.016 = 101,600 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.016 \times 0.5\% = 508 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 101,600 - 508 = 101,092 \text{ 元}$$

即: 投资者赎回 10 万份 A 类基金份额且持有时间不满 365 天, 假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.016 元, 则其可得到的赎回金额为 101,092 元。

例 2: 某投资人赎回本基金 10 万份 C 类基金份额, 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 1.016 元, 则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=100,000 × 1.016=101,600 元

赎回费用=100,000 × 1.016 × 0.5%=508 元

赎回金额=101,600-508.00=101,092 元

即: 投资人赎回本基金 10 万份 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 1.016 元, 则其可得到的净赎回金额为 101,092 元。

3、本基金申购份额的计算公式仅适用于前端收费, 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, 并及时公告。

4、基金份额净值计算

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日收市后计算, 并在 T+1 日内公告。遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。基金份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此误差产生的损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有。

7.8 申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后, 基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记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。

投资者赎回基金成功后, 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。

基金管理人可以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, 基金管理人最迟于开始实施前在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

7.9 暂停或拒绝申购、赎回的情形和处理方式

1、发生下列情况时, 基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请:

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运转。
- (2) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- (3) 证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%, 或者变相规避 50%集中度的情形。

(7) 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。

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 (1)、(2)、(3)、(5)、(7)、(8) 项暂停申购情形时, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝, 被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

(3) 证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(5) 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。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时, 基金管理人应在当日报中国证监会备案, 已确认的赎回申请, 基金管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付, 并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 (4) 项所述情形, 按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时, 基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

3、暂停基金的申购、赎回, 基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的, 基金管理人当日应立即向中国证监会备案, 并依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停公告。

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

(3) 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(4) 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

7.10 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 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。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

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 日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告, 并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案, 并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人, 并说明有关处理方法。

7.11 基金的转换

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

7.12 定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下, 本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务, 具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公告为准。

§ 8 基金的投资

8.1 投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。

8.2 投资理念

指数化投资可以以较低的成本获取良好的市场长期回报,投资于具有良好代表性、流动性与投资性的指数可以有效分享经济快速增长过程中带来的投资机会。

8.3 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括央视财经 50 指数的成份券、备选成份券、新股(含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%,投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 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。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

8.4 业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为央视财经 50 指数。

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》要求(因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,

并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决, 基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的, 基金合同终止。

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

2、业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 央视财经 50 指数收益率 \times 95% + 金融机构人民币活期存款基准利率 (税后) \times 5%。

除上述“1、标的指数”中所述情形外, 若本基金标的指数发生变更, 基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时, 本基金基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。本基金由于上述原因变更业绩比较基准, 无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

8.5 风险收益特征

本基金属于股票型指数基金, 在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种, 本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现, 具有与标的指数相似的风险收益特征。

8.6 投资策略

本基金以央视财经 50 指数为标的指数, 采用完全复制法, 按照标的指数成份券组成及其权重构建基金股票投资组合, 进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份券组成及其权重来拟合复制标的指数, 并根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整, 以复制和跟踪标的指数。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。

当预期成份券发生调整, 成份券发生配股、增发、分红等行为, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响, 导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份券的流动性进行分析, 如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:

(1) 基本面替代: 按照与被替代股票所属行业, 基本面及规模相似的原则, 选取一揽子标的指数成份券作为替代股备选库;

(2) 相关性检验: 计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合, 以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标, 求解组合中替代股票的权重, 并构建替代股组合。

本基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度, 每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因, 并优化跟踪偏离度管理方案。

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的, 在考虑流动性风险的前提下, 构建债券投资组合。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略, 根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化, 并利用债券定价技术, 进行个券选择, 同时着重考虑基金的流动性管理需要进行配置。

本基金管理人可运用股指期货, 以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 参与股指期货的投资, 以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究, 结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平, 采用流动性好、交易活跃的期货合约, 达到有效跟踪标的指数的目的。此外, 本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理, 如预期大额申购赎回、大量分红等, 以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

在控制风险的前提下, 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略, 基于对基础证券投资价值的深入研究判断, 进行存托凭证的投资。

8.7 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

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则; 决定有关标的指数重大调整应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策; 基金经理根据投资决策委员会的决策, 负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

(1) 投资决策委员会依据相关研究分析报告, 定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议, 决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议, 进行基金投资管理的日常决策。

- (2) 基金经理依据指数编制单位公布的指数成份券名单及权重, 进行投资组合构建;

(3) 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;

(4) 基金经理根据指数成份券或权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份券派息情况等, 适时进行投资组合调整;

8.8 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, 但是法律法规或监管部门另有规定的除外;
- (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) 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。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%, 投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 90%;
- (2) 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%;
- (3) 本基金参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (4) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 其中, 有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等; 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算)) 不低于基金资产净值的 90%, 且不得超过基金资产净值的 95%;

(5) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(6) 本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,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%,本基金管理人管理的基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证 10%。投资于其他权证的投资比例,遵从法律法规或监管部门的相关规定;

(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投资范围和投资比例的约定;

(10) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

除上述第(2)、(5)、(7)、(8)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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

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

8.9 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、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;
- 2、有利于基金资产的安全与增值;
- 3、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,保护基金份额持有人的利益;
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益;
- 5、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。

8.10 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

8.11 基金投资组合报告

招商央视财经 50 指数证券投资基金管理人 – 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 2025 年 12 月 31 日，来源于《招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》。

1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	495,979,056.21	94.27
	其中：股票	495,979,056.21	94.27
2	基金投资	-	-
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	27,783,584.19	5.28
8	其他资产	2,340,678.85	0.44
9	合计	526,103,319.25	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	12,990,618.00	2.47
C	制造业	299,926,815.23	57.14
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	2,130,733.72	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	3,939,530.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,388,318.14	3.69
J	金融业	149,689,525.89	28.52
K	房地产业	4,210,175.10	0.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,400,619.92	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	995,411.70	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	494,671,747.70	94.24

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	98,476.56	0.02
C	制造业	384,569.84	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	795,125.76	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,694.44	0.01
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,441.91	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,307,308.51	0.25

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	4,733,741	37,538,566.13	7.15
2	601166	兴业银行	1,737,504	36,591,834.24	6.97
3	601318	中国平安	487,468	33,342,811.20	6.35
4	600276	恒瑞医药	507,316	30,220,814.12	5.76
5	600887	伊利股份	1,028,000	29,400,800.00	5.60
6	600519	贵州茅台	19,433	26,762,738.94	5.10
7	603986	兆易创新	106,900	22,903,325.00	4.36
8	300136	信维通信	361,343	22,403,266.00	4.27
9	002415	海康威视	625,700	18,670,888.00	3.56
10	000333	美的集团	231,626	18,101,571.90	3.45

注：因本基金被动复制指数成分股需要，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定要求，经本基金管理人董事会以及本基金托管行同意，报告期内，本基金参与投资了招商银行。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600930	华电新能	127,424	795,125.76	0.15
2	688525	佰维存储	1,114	127,876.06	0.02
3	001280	中国铀业	2,171	98,476.56	0.02
4	301656	联合动力	3,781	96,264.26	0.02
5	001233	海安集团	367	19,039.96	0.00

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资,以改善组合的风险收益特性。本基金主要通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,采用流动性好、交易活跃的期货合约,达到有效跟踪标的指数的目的。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

11 投资组合报告附注

11.1

报告期内基金投资的前十名证券除工商银行(证券代码 601398)、兴业银行(证券代码 601166)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、工商银行 (证券代码 601398)

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

2、兴业银行 (证券代码 601166)

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

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,因复制指数被动持有,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。

11.2

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。

11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	55,223.28
2	应收证券清算款	1,951,607.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	333,848.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,340,678.85

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600930	华电新能	795,125.76	0.15	新股流通受限
2	001280	中国铀业	98,476.56	0.02	新股流通受限
3	301656	联合动力	96,264.26	0.02	新股流通受限
4	001233	海安集团	19,039.96	0.00	新股流通受限

§ 9 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：

招商央视财经 50 指数 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
2013.02.05-2013.12.31	0.50%	1.12%	-3.57%	1.23%	4.07%	-0.11%
2014.01.01-2014.12.31	26.27%	1.09%	25.29%	1.08%	0.98%	0.01%
2015.01.01-2015.12.31	14.18%	2.41%	15.19%	2.30%	-1.01%	0.11%
2016.01.01-2016.12.31	0.41%	1.37%	-2.23%	1.24%	2.64%	0.13%
2017.01.01-2017.12.31	42.89%	0.78%	42.81%	0.78%	0.08%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-23.04%	1.42%	-24.67%	1.40%	1.63%	0.02%
2019.01.01-2019.12.31	44.47%	1.22%	36.44%	1.21%	8.03%	0.01%
2020.01.01-2020.12.31	34.94%	1.27%	21.05%	1.28%	13.89%	-0.01%
2021.01.01-2021.12.31	-2.53%	1.08%	-8.12%	1.07%	5.59%	0.01%
2022.01.01-2022.12.31	-13.48%	1.16%	-16.11%	1.14%	2.63%	0.02%
2023.01.01-2023.12.31	-2.98%	0.78%	-5.26%	0.77%	2.28%	0.01%
2024.01.01-2024.12.31	16.85%	1.18%	13.11%	1.16%	3.74%	0.02%
2025.01.01-2025.12.31	13.50%	0.77%	9.75%	0.76%	3.75%	0.01%
自基金成立起至 2025.12.31	238.49%	1.27%	119.17%	1.25%	119.32%	0.02%

注：本基金合同生效日为 2013 年 2 月 5 日。

招商央视财经 50 指数 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	15.02%	0.90%	15.01%	0.90%	0.01%	0.00%
2018.01.01-2018.12.31	-23.34%	1.42%	-24.67%	1.40%	1.33%	0.02%
2019.01.01-2019.12.31	43.89%	1.22%	36.44%	1.21%	7.45%	0.01%
2020.01.01-2020.12.31	34.38%	1.27%	21.05%	1.28%	13.33%	-0.01%
2021.01.01-2021.12.31	-2.92%	1.08%	-8.12%	1.07%	5.20%	0.01%
2022.01.01-2022.12.31	-13.83%	1.16%	-16.11%	1.14%	2.28%	0.02%
2023.01.01-2023.12.31	-3.37%	0.78%	-5.26%	0.77%	1.89%	0.01%
2024.01.01-2024.12.31	16.37%	1.18%	13.11%	1.16%	3.26%	0.02%

2025.01.01-2025.12.31	13.05%	0.77%	9.75%	0.76%	3.30%	0.01%
自基金成立起至 2025.12.31	81.32%	1.12%	29.73%	1.11%	51.59%	0.01%

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。

§ 10 基金的财产

10.1 基金资产总值

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

10.2 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

10.3 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。

10.4 基金财产的处分

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

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

§ 11 基金资产的估值

11.1 估值日

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

11.2 估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

11.3 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、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。

4、本基金投资存托凭证的估值核算, 依照境内上市交易的股票执行。

5、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。

6、因持有股票而享有的配股权, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

7、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。

8、股指期货品种将按照相关规定规则进行估值。

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

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

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

11.4 估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后, 基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算, 精确到 0.0001 元, 小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后, 将基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。

11.5 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时, 视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1、估值错误类型

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

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

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。

11.6 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、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;

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

11.7 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人, 由基金管理人对基金净值予以公布。

§ 12 基金的收益分配

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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 20%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、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;

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

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、基金可供分配利润为正的前提下,方可进行收益分配;

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位开始舍去,舍去部分归基金资产;

7、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

12.4 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、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。

12.5 收益分配方案的确定与公告

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

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

12.6 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、基金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。

§ 13 基金的费用与税收

13.1 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、律师费和诉讼费；
 - 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。

13.2 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

- 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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。

- 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, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 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。

上述“13.1 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。”

13.3 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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

13.4 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后, 可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率, 须召开基金份额持有人大会审议; 调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率, 无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

13.5 基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

§ 14 基金份额的注册登记、非交易过户、转托管、冻结与解冻

14.1 基金份额的注册登记

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

本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、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事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

注册登记机构享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒体上公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其它情形除外；
- 5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6、接受基金管理人的监督；
- 7、法律法规规定的其他义务。

14.2 基金的非交易过户

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

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

14.3 基金的转托管

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

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因,可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

14.4 基金冻结与解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务,由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或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的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结基金份额所产生的权益一并冻结,法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时,基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

§ 15 基金的会计和审计

15.1 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

15.2 基金年度审计

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

§ 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》、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、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内, 将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“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、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的, 以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字; 除特别说明外, 货币单位为人民币元。

16.5 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

- 1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后,基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上;基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

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

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

2、基金份额发售公告

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

3、基金合同生效公告

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

4、基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

5、基金份额申购、赎回价格

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

6、基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒体上。

基金合同生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

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

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。

7、临时报告

本基金发生重大事件, 有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书, 予以公告, 并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件, 是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- (1) 基金份额持有人大会的召开;
- (2) 终止基金合同;
- (3) 转换基金运作方式;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金募集期延长;
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;

- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- (14) 重大关联交易事项;
- (15) 基金收益分配事项;
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- (17) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;
- (18) 基金改聘会计师事务所;
- (19) 变更基金销售机构;
- (20) 更换基金登记机构;
- (21) 本基金开始办理申购、赎回;
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期办理;
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- (26) 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;
- (27) 中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

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

9、基金份额持有人大会决议

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

10、中国证监会规定的其他信息。

16.6 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

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

16.7 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。

§ 17 风险揭示与管理

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，投资人购买基金，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，投资人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，投资人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，投资人承担的风险也越大。

投资人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人的风险承受能力相适应。

本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种。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.cmfchina.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。

投资人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人进行长期投资、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，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金管理人提请投资人特别注意，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人基金投资的“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,由投资人自行承担。

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

货币政策、财政政策、产业政策、国有股减持与流通政策等国家经济政策的变化会对证券市场产生影响,导致证券市场价格波动而产生的风险。

2、经济周期风险

股市是国民经济的晴雨表。因此,宏观经济运行的周期性波动将会通过证券市场反映出来,对证券市场的收益水平产生影响,从而产生风险。

3、利率风险

利率的变化直接影响着债券的价格和收益率,同时也影响到证券市场资金供求关系,并在一定程度上影响上市公司的盈利水平,上述变化将在一定程度上影响本基金的收益。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果本基金所投资的上市公司盈利下降,其股票价格可能会下跌,或能够用于分配的利润减少,导致本基金投资收益减少。

5、购买力风险

本基金的利润将主要采取现金形式来分配,而通货膨胀将使现金购买力下降,从而影响基金所产生的实际收益率。

17.2 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整个股票市场,标的指数成份券的平均回报率与整个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

标的指数成份券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、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内,年化跟踪误差控制在 4% 以内,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

6、成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份券停牌时,基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

17.3 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、由于标的指数调整成份券或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2、由于标的指数成份券发生配股、增发、分红等行为,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3、由于成份券停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、由于基金投资过程中的证券交易成本,以及基金管理费和托管费等费用的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5、在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

6、其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因基金申购与赎回带来的现金变动等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

17.4 流动性风险

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，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行的股票、存托凭证、债券、货币市场工具等），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、部分延期赎回或暂停赎回。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赎回需求的情形时，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。

17.5 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。

17.6 存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证,可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;存托凭证退市的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

17.7 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

17.8 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、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、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。

5、债券回购风险

债券回购为提升基金组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。例如:回购交易中,交易对手在回购到期时不能偿还全部或部分证券或价款,造成基金资产损失的风险;回购利率大于债券投资收益而导致的风险;由于回购操作导致投资总量放大,进而放大基金组合风险的风险;债券回购在对基金组合收益进行放大的同时,也放大了基金组合的波动性(标准差),基金组合的风险将会加大;回购比例越高,风险暴露程度也就越高,对基金净值造成损失的可能性也就越大。如发生债券回购交收违约,质押券可能面临被处置的风险,因处置价格、数量、时间等的不确定,可能会给基金资产造成损失。

§ 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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

18.2 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

发生上述情形，基金管理人应当及时通知基金托管人。

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本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

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

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

3、基金财产清算程序:

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

基金财产清算的期限为 6 个月。

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、基金财产清算剩余资产的分配

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

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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

§ 19 基金合同的内容摘要

19.1 基金合同当事人及其权利义务

1、基金管理人的权利

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督;

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告;

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

3、基金托管人的权利

(1) 自基金合同生效之日起, 依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;

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

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

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

(7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人未执行基金合同规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册;

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作;

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

(1) 认真阅读并遵守基金合同;

(2) 了解所投资基金产品, 了解自身风险承受能力, 自行承担投资风险;

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

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

2、当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开基金份额持有人大会:

- (1) 终止基金合同;
- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 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;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 本基金与其他基金的合并;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

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

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

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

3、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费;
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率;

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

(7) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

4、会议召集人及召集方式:

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

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

60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集。

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

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

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

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

5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前 40 日,在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式;

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

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

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

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

6、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

- 2) 经核对, 汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示, 有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%) 。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议规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规定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:

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

- 2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人 (如果基金托管人为

召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上 (含 50%) 选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

2) 通讯开会

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

8、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

9、计票

(1) 现场开会

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

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

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

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

(2) 通讯开会

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

10、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

19.3 基金收益与分配

1、基金收益的构成

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。

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。

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 20%, 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 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;

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(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) 基金可供分配利润为正的前提下, 方可进行收益分配;

(6) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位, 小数点后第 3 位开始舍去, 舍去部分归基金资产;

(7) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、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。

5、收益分配方案的确定与公告

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

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

6、收益分配中发生的费用

(2) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

(2) 基金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。

19.4 基金费用与税收

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、律师费和诉讼费;

(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。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 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。

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, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 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。

上述“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。”

4、不列入基金费用的项目

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

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3) 基金合同生效前的相关费用;

(4) 标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担, 不得从基金财产中列支;

(5) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

5、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

6、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

19.5 基金的投资

1、投资目标

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,实现对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。

2、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括央视财经 50 指数的成份券、备选成份券、新股(含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%,投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 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。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、投资禁止行为与限制

(1) 禁止用本基金财产从事以下行为

- 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,但是法律法规或监管部门另有规定的除外;

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

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、行政法规有关法律法规规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(2) 基金投资组合比例限制

1) 本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%, 投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 90%;

2) 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%;

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

4) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 其中, 有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等; 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 不低于基金资产净值的 90%, 且不得超过基金资产净值的 95%;

5) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券, 其中, 现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

6) 本基金投资权证, 在任何交易日买入的总金额, 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%, 本基金管理人管理的基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证 10%。投资于其他权证的投资比例, 遵从法律法规或监管部门的相关规定;

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投资范围和投资比例的约定;

10) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

除上述第 2)、5)、7)、8) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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

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

19.6 基金资产净值的计算和确认

1、基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

2、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

3、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

19.7 基金合同的变更和终止

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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

(2) 关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

(4) 基金合同约定的其他情形;

(5) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

发生上述情形, 基金管理人应当及时通知基金托管人。

19.8 争议的处理和适用的法律

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

本基金合同受中国法律管辖。

19.9 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: 王颖

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 (或简称“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: 人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

法定代表人: 葛海蛟

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

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

1、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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括央视财经 50 指数的成份券、备选成份券、新股（含首次公开发行和增发）、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%，投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 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。

基金管理人应将拟投资的股票库、央视财经 50 指数成份券和备选成份券股票库、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。

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：

1) 本基金投资于股票、存托凭证的资产比例为基金资产的 85%-95%，投资于央视财经 50 指数成份券和备选成份券的资产不低于股票、存托凭证资产的 90%；

2) 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%；

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

4) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的 90%，且不得超过基金资产净值的 95%；

5) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券; 其中, 现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

6) 本基金投资权证, 在任何交易日买入的总金额, 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%, 本基金管理人管理的基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证 10%。投资于其他权证的投资比例, 遵从法律法规或监管部门的相关规定;

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; 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;

9) 本基金不得违反基金合同关于投资范围和投资比例的约定;

10) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

除上述第 2)、5)、7)、8) 项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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

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

(3) 对基金禁止从事的关联交易进行监督。

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, 但是法律法规或监管部门另有规定的除外;
- 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) 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。

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。

(4) 基金管理人向基金托管人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, 及时对交易对手库予以更新和调整, 并通知基金托管人。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。

2、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。

3、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。

4、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。

5、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 基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动, 包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款, 均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

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、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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

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

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

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

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和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户, 并代表基

金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国人民银行报备。

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资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个交易日结束后计算当日的该基金份额资产净值,并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核,并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(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) 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和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定期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; 招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次, 于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告; 半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告; 年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。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、半年度报告或者年度报告。

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。基金管理人在半年度报告完成当日,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 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,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基金份额持有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。

招商基金网站: www.cmfchina.com

招商基金 APP: 招商基金

招商基金微信公众号: 招商基金

21.2 资料的寄送服务

1、本基金管理人至少每年度以电子邮件、短信、微信或其他与投资人约定的形式向通过招商基金直销平台持有本公司基金份额的基金份额持有人提供基金保有情况信息。

本基金管理人有权按照法规要求及基金份额持有人的定制情况,选择通过纸质、电子邮件、短信或微信等方式提供对账单。客户可通过招商基金客户服务热线、在线客服或者招商基金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。

由于基金份额持有人预留的联系方式不详、错误或者未及时变更,可能导致基金保有情况信息或对账单无法按时或准确送达。基金份额持有人可以通过招商基金网站、招商基金 APP、在线客服或拨打客户服务热线查询、变更预留联系方式。

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失、遗漏、破损、内容泄露等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。因此本基金管理人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未发送成功、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,在不违反法律法规规定的前提下,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网站、客户服务热线提交信息定制申请,基金管理人可以选择通过短信或电子邮件等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、公司最新公告提示等,基金管理人可以根据业务发展的实际需要,适时调整定制信息的内容。

21.4 网络在线服务

基金份额持有人通过绑定手机号、基金账号或开户证件号码及登录密码登录招商基金网站,可获取账户查询、信息定制、资料修改等多项在线服务。

招商基金网站: www.cmfchina.com

招商基金电子邮箱: cmf@cmfchina.com

21.5 客服热线电话服务

招商基金客户服务热线提供全天候 24 小时的自助语音查询服务,基金份额持有人可进行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获取业务咨询、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

21.6 客户投诉受理服务

基金份额持有人可以通过招商基金网站、客户服务热线、书信、电子邮件及各销售机构等不同的渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

§ 22 其他应披露事项

序号	公告事项	公告日期
1	招商央视财经 50 指数证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	2025-01-27
2	招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第一号）	2025-01-27
3	招商央视财经 50 指数证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	2025-01-27
4	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	2025-03-08
5	招商央视财经 50 指数证券投资基金基金合同（2025 年 3 月 21 日修订）	2025-03-19
6	关于招商基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	2025-03-19
7	招商央视财经 50 指数证券投资基金托管协议（2025 年 3 月 21 日修订）	2025-03-19
8	招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第二号）	2025-03-21
9	招商央视财经 50 指数证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	2025-03-21
10	招商央视财经 50 指数证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	2025-03-21
11	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2024 年年度报告	2025-03-28
12	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	2025-03-28
13	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	2025-04-08
14	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	2025-04-21
15	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	2025-04-21
16	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	2025-05-09
17	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-05-20
18	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-05-30
19	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-06-19
20	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-06-27
21	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	2025-07-18
22	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	2025-07-18
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-08-23
24	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-08-26
25	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	2025-08-28
26	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年中期报告	2025-08-28
27	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-09-24
28	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	2025-10-27
29	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	2025-10-27
30	关于招商央视财经 50 指数证券投资基金基金经理变更的公告	2025-11-13
31	招商央视财经 50 指数证券投资基金更新的招募说明书（二零二五年第	2025-11-18

	三号)	
32	招商央视财经 50 指数证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	2025-11-18
33	招商央视财经 50 指数证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	2025-11-18
34	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-11-27
35	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-12-31
36	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	2026-01-21
37	招商央视财经 50 指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	2026-01-21

§ 23 招募说明书的存放及查阅方式

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、基金份额发售机构和注册登记人的住所,并刊登在基金管理人、基金托管人的网站上。

23.2 招募说明书的查阅方式

投资人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央视财经 50 指数证券投资基金募集的文件
- 2、《招商央视财经 50 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《招商央视财经 50 指数证券投资基金托管协议》
- 4、《招商央视财经 50 指数证券投资基金代销协议》
- 5、《招商央视财经 50 指数证券投资基金注册登记协议》
- 6、《律师事务所法律意见书》
- 7、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
- 8、中国银行股份有限公司业务资格批件和营业执照

招商基金管理有限公司
2026 年 2 月 4 日