建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金

招募说明书（更新）

—2011 年第 1 号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一一年一月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2010年3月26日证监许可[2010]378号文核准募集。本基金的基金合同于2010年5月28日正式生效。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，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。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、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，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为上证社会责任 ETF 的联接基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2010年11月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

目　　录

一、绪言 5

二、释义 6

三、基金管理人 11

四、基金托管人 20

五、相关服务机构 27

六、基金的募集 36

七、基金合同的生效 41

八、基金份额的申购与赎回 42

九、基金的投资 54

十、基金的业绩 67

十一、基金的财产 69

十二、基金资产的估值 71

十三、基金的收益分配 77

十四、基金的费用与税收 79

十五、基金的会计与审计 82

十六、基金的信息披露 83

十七、风险揭示 87

十八、基金的终止与清算 92

十九、基金合同的内容摘要 94

二十、基金托管协议的内容摘要 119

二十一、对基金份额持有人的服务 136

二十二、其他应披露事项 139

二十三、招募说明书的存放及查阅方式 142

二十四、备查文件 143

一、绪言

《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》（以下简称“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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关法律法规的规定以及《建信上证社会责任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”或《基金合同》）编写。

本招募说明书阐述了建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。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。基金投资者依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，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。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

《基金合同》	《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对其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
《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》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金
招募说明书	《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，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，及其定期的更新
托管协议	基金管理人与基金托管人签订的《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及其任何有效修订和补充
发售公告	《建信上证社会责任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》
《业务规则》	《建信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
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
基金代销机构	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
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	办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为建信基金管理有限责任公司
《基金合同》当事人	受《基金合同》约束，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
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
投资者	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
标的指数	指上证社会责任指数及其未来可能发生的变更
目标 ETF	指另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（简称 ETF），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。发售时，本基金选择上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金（以下简称上证社会责任 ETF）为目标 ETF
ETF 联接基金	指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标 ETF 的 ETF 联接基金
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
募集期	自基金份额发售之日起不超过 3 个月的期限
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
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）
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。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
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。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请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
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任一开放式基金（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、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
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
基金收益	基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入
基金资产总值	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
基金资产净值	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	基金资产净值除以基金份额总数
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
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
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。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

设立日期：2005年9月19日

法定代表人：江先周

联系人：路彩营

电话：010-66228888

注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务公司	25%
中国华电集团公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 9 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由 5 名监事组成，其中包括 2 名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门以及深圳分公司、成都分公司、北京分公司和上海分公司。此外，公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

江先周先生，董事长。1982年毕业于东北财经大学，获经济学学士学位。1986年获财政部财政科学研究所经济学硕士学位。1993年获英国Heriot-Watt大学商学院国际银行金融学硕士学位。历任中国建设银行行长办公室副处长，中国建设银行国际业务部处长，中国建设银行行长办公室副主任，中国建设银行国际业务部副总经理，中国建设银行基金托管部总经理，中国建设银行基金托管部总经理兼机构业务部总经理。

孙志晨先生，董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA学位。历任中国建设银行筹资部证券处副处长，中国建设银行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行个人银行业务部副总经理。

马梅琴女士，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部证券处副处长、中国建设银行筹资储蓄部外币储蓄处处长、中国建设银行零售业务部自动服务处处长、中国建设银行个人银行业务部证券业务处处长、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理兼证券处高级经理、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理、中国建设银行个人金融业务部副总经理。

俞斌先生，董事，现任中国建设银行财会部处长、总经理助理。1992年获南京大学计算数学专业硕士学位。历任中国建设银行江苏分行泰州分行行长助理、副行长。

欧阳伯权先生，董事，现任美国信安金融集团总裁—亚洲。1977 年获加拿大滑铁卢大学城市设计及环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训员、团体核保总监，美国友邦保险公司亚洲区团体保险部副总裁，信

安国际有限公司亚洲区行政总裁。

殷红军先生，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理、党组成员。1995 年毕业于山东省教育学院数学系，获学士学位；1998 年毕业于首都经济贸易大学经济信息系，获硕士学位。历任中国电力财务公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室、体制改革办公室一处副处长、中国华电集团公司体制改革办公室一处、体制改革处处长、中国华电集团公司政策与法律事务部政策研究处处长。

顾建国先生，独立董事，现任香港华建国际集团公司总经理。1984 年获浙江工业大学管理工程学学士学位，1991 年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位，1994 年获财政部财科所研究生部财务学博士学位。历任中国建设银行总行信托投资公司总裁助理兼财会部经理、中国建设银行总行会计部副总经理、香港华建国际集团公司副总经理。

关启昌先生，独立董事，现任 MORRISON & Company Limited 总裁。1970 年获新加坡大学会计学（荣誉）学士学位。并于 1992 年修完斯坦福大学行政人员课程。历任 Accountant General's Office, Singapore Government 会计师、Turquand Young, Chartered Accountants Hong Kong 核数师、Irish,Young & Outhwaite 核数师、Bechwith Kwan & Company, Chartered Accountants Australia and Hong Kong 合伙人、美林证券总裁、协和集团董事兼总经理、Morrison & Co.LTD 总裁。

沈四宝先生，独立董事，现任对外经贸大学法学院院长。1981 年获北京大学法律系国际经济法学硕士学位。历任北京大学助教、对外经济贸易大学法学院院长。

2、监事会成员

冯丽英女士，监事会主席，现任中国建设银行人力资源部副总经理（部门总经理级）。历任中国建设银行人事部劳动工资处副处长、处长，中国国际金融有限公司人力资源部高级经理，中国信达资产管理公司人力资源部组织部副部长、副主任、薪酬委员会办公室主任。

谭旭耀先生，监事，现任信安国际公司亚洲区财务分析专员，负责信安亚洲区营运公司财务事务管理、信安亚洲区业务财务分析及预测、项目管理、资

本计划、并购活动、策略分析、风险管理、精算事务等。

唐湘辉女士，监事，现任中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理。1994 年获北京物资学院经济学学士，2007 年获得清华－麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心职员、原电力工业部经济调节司科员、国家电力公司财务与资产管理部职员、中国华电集团公司结算中心副处长（主持工作）、中国华电集团财务有限公司结算管理部副经理（主持工作）、中国华电集团公司金融管理部副处长（主持工作）、华电扬州发电有限公司副总经理（挂职锻炼）。

翟峰先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988 年获得安徽省安庆师范学院文学学士学位，1990 年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者，秘鲁首钢铁矿股份有限公司内部审计部副主任，中国信达信托投资有限公司（原名为中国建设银行信托投资公司）证券发行部副总经理，宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理，上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴洁女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总监。1992 年毕业于南开大学金融系，1995 年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理（主持工作）。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总经理（简历请参见董事会成员）。

何斌先生，副总经理。1992 年获东北财经大学计划统计系学士学位。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部、国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长。

张延明先生，副总经理。1993 年获中国人民大学投资经济系学士学位，1997 年获中国人民大学投资经济系硕士学位。先后供职于深圳市建设集团、中国建设银行，历任中国建设银行信贷管理部主任科员、中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006 年 11 月加入建信基金管理有限责任公司，任总经理助理；2008 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司副总经理。

王新艳女士，副总经理。注册金融分析师（CFA），中国人民银行研究生

部硕士。1998 年 10 月加入长盛基金管理公司，历任研究员、基金经理助理，2002 年 11 月 2 日至 2004 年 5 月 22 日担任长盛成长价值股票型证券投资基金的基金经理。2004 年 6 月加入景顺长城基金管理公司，历任基金经理、投资副总监、投资总监等职，2005 年 3 月 16 日至 2009 年 3 月 16 日期间担任景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2007 年 6 月 18 日至 2009 年 3 月 16 日期间担任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009 年 3 月加入本公司，任总经理助理，2010 年 5 月起任副总经理。2009 年 12 月 17 日起任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2010 年 4 月 27 日起任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理；2010 年 11 月 16 日起任建信内生动力股票型证券投资基金的基金经理。

4、督察长

路彩营女士，督察长。1979 年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长，华夏证券部门副总经理，宝盈基金管理公司首席顾问（公司副总经理级），建信基金管理有限责任公司监事长。

5、本基金基金经理

梁洪昀先生，投资管理部副总监。注册金融分析师（CFA），证券从业经历 7 年，现任建信基金管理有限责任公司投资管理部副总监。2003 年 1 月获清华大学经济学博士学位。2003 年 1 月至 2005 年 8 月，就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监，2009 年 9 月起任投资管理部副总监。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理；2010 年 5 月 28 日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总经理。

王新艳女士，副总经理。

汪沛先生，投资管理部总监。

梁洪昀先生，投资管理部副总监。

卓利伟先生，建信恒久价值基金、建信收益增强基金、建信内生动力基金的基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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、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、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产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，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、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）不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

（2）独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

（3）相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

（4）有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

（5）防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。

（6）适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立了审计与风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进

行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，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、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

（4）信息与沟通

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。

（5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

组织形式：国有独资

存续期间：持续经营

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：蒋松云

（二）主要人员情况

截至2010年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工121人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。。

（三）基金托管业务经营情况

“作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年开展托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，严格履行资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队，为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品等门内齐全的托管产品体系。截至2010年9月，中国工商银行共托管证券投资基金177只，其中封闭式8只，开放式169只。2010年，中国工商银行

凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。”

（四）基金托管人的职责

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名册登记、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；如果基金管理人有未执行《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、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；

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。

（五） 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007年两次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2009年中国工商银行资产托管部第三次通过SAS70审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立

第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，SAS70审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

⑴合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

⑵完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

⑶及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

⑷审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

⑸有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离;直接操作人员和控制人员应相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（六）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《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资

是否符合有关法律法规的规定及基金合同的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）直销机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：江先周

联系人：孙桂东

电话：010-66228800

（2）代销机构

1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：郭树清

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（4）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（5）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

网址：www.95559.com.cn

（6）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：傅育宁

客户服务电话：95555

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

（7）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：董文标

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

（8）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 号北京银行大厦

法定代表人：闫冰竹

客户服务统一咨询电话： 010-96169（北京） 022-96269（天津）

021-53599688（上海）029-85766888（西安）

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（9）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（10）中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

客服电话：95558

网址：www.citics.com

（11）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市市南区东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

客服电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

（12）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（13）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（14）中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座

法定代表人：刘军

客服电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

（15）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：魏云鹏

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

（16）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：400-8888-001，（021）962503

网址：www.htsec.com

（17）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（18）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

（19）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦 25 、24 楼

法定代表人：马昭明

客户服务电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

（20）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（21）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

（22）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址： www.qlzq.com.cn

（23）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市人民大街 138－1 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：www.nesc.cn

（24）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：张志军

客户服务电话: 4006515988

网址：www.bhzq.com

（25）广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客户服务电话：020-95575

网址：www.gf.com.cn

（26）广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

（27）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（28）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话: 4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

（29）财富证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：www.cfzq.com

（30）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

客服热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

（31）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

客服热线：4008888588

网址：www.longone.com.cn

（32）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（33）中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层

法定代表人：杨小阳

开放式基金咨询电话：4006008008

网址： www.cjis.cn

（34）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：0755－82825555

网址：www.axzq.com.cn

（35）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（36）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

（37）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

客户服务热线：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（38）红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

客服电话：0871-3577888

网址：www.hongtastock.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：江先周

联系人：路彩营

电话：010-66228888

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010－66575888

传真：010－65232181

经办律师：徐建军、李晓明

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系人：王鸣宇

联系电话：021-61238888

传真：021-61238800

经办注册会计师：许康玮　王鸣宇

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会 2010 年 3 月 26 日证监许可[2010]378 号文核准。

（二）基金类型

ETF 联接基金

（三）基金的运作方式

契约型开放式。

（四）基金存续期间

不定期。

（五）基金的面值

本基金每份基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

（六）本基金与目标 ETF 的联系和区别

本基金为上证社会责任 ETF 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，上证社会责任 ETF 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上证社会责任 ETF，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上证社会责任 ETF，也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求，实物申赎上证社会责任 ETF；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。

本基金与上证社会责任 ETF 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。上证社会责任 ETF 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。上证社会责任 ETF 采取实物申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

（七）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

（八）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月。

本基金自 2010 年 4 月 21 日至 2010 年 5 月 21 日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七章第（一）条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

本基金基金合同已于 2010 年 5 月 28 日生效。

（九）募集对象

指个人投资者、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证券投资基金的其他投资者。

（十）募集场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点向投资者公开发售。

具体募集场所见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

（十一）认购安排

1、认购时间：本基金向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、投资者认购应提交的文件和办理的手续：详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

3、认购原则和认购限额：认购以金额申请。投资者认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项，投资者可以多次认购本基金份额，认购费率按单笔认购金额计算。

代销网点每个基金账户每次认购金额不得低于 1000 元人民币，代销机构另有规定的，从其规定。直销机构每个基金账户首次认购金额不得低于 5 万元人民币，已在直销机构有认购本基金记录的投资者不受上述认购最低金额的限制，单笔追加认购最低金额为 1000 元人民币。当日的认购申请在销售机构规定的时间之后不得撤销。

（十二）认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，具体费率结构如下表所示：

认购金额（M）	认购费率
M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<500 万元	0.5%
M≥500 万元	1000 元/笔

本基金认购费由认购人承担，可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

（十三）认购份数的计算

认购本基金的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有，如基金合同生效，则折算为基金份额计入投资者的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准，投资者的总认购份额的计算方式如下：

净认购金额 = 认购金额/（1＋认购费率）

认购费用 = 认购金额-净认购金额

认购份额 = （净认购金额＋认购利息）/ 基金份额初始发售面值

认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

（十四）认购的方法与确认

1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、认购确认

基金销售网点受理投资者的申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

（十五）募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息，在基金合同生效后折算为基金份额归基金份额持有人所有，不收取认购费用。利息以注册登记机构的记录为准。

计算结果按照四舍五入方式，保留到小数点后两位，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。

例：某投资人投资 10000 元认购本基金的基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额=10000/（1+1.2%）=9881.42 元

认购费用=10000-9881.42=118.58 元

认购份额=（9881.42+5）/1.00=9886.42 份

即投资人投资 10000 元认购本基金的基金份额，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 9886.42 份基金份额。

（十六）募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

（十七）募集结果

截至 2010 年 5 月 21 日，基金募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为人民币 2,396,209,783.92 元。本次募集所有认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 262,200.84 元。本次募集有效认购户数为 50,283 户，按照每份基金份额初始面值人民币 1.00 元计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计 2,396,471,984.76 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次募集所有资金已于 2010 年 5 月 27 日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管专户。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

1、基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购户数不少于 200 户，同时本基金目标 ETF 符合基金合同生效实质要件的条件下，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。本基金合同已于 2010 年 5 月 28 日生效。

3、本基金基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金基金合同生效后折成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转成基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（二）基金募集失败时的处理方式

1、基金募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括本基金管理人和本基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。销售机构名单和联系方式见上述第五章第（一）条。

基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

在基金开放日，投资者提出的申购、赎回申请时间应在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间（目前为下午3：00）之前，其基金份额申购、赎回的价格为当日的价格；如果投资人提出的申购、赎回申请时间在上海证券交易所与深圳证券交易所当日收市时间之后，其基金份额申购、赎回的价格为下一开放日的价格。

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。

2、申购与赎回的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过3个月的时间起开始办理申购。

本基金自基金合同生效日后不超过3个月的时间起开始办理赎回。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

本基金已于2010年7月12日起开始日常赎回业务，已于2010年7月14日起开始办理日常申购业务。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回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”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在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。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回的申请方式

投资者必须根据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。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购与赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T＋2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

3、申购与赎回申请的款项支付

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，申购款项将退回投资者资金账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构及相关销售机构在T＋7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人资金账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金基金合同有关条款处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、本基金代销网点每个基金账户单笔申购最低金额为1000元人民币，代销机构另有规定的，从其规定；直销机构每个基金账户首次最低申购金额为5万元人民币，已在直销机构有申购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购最低金额为1000元人民币；

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于1000份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足100份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前2个工作日至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

（六）申购费率与赎回费率

1、申购费率

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过1.5%：

申购金额（M）	申购费率
M<100 万元	1.5%
100 万元≤M<500 万元	0.7%
M≥500 万元	1000 元/笔

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

2、赎回费率

持有期限（Y）	赎回费率
持有期<1 年	0.5%

1 年≤持有期<2 年	0.3%
持有期≥2 年	0%

赎回费用由赎回人承担，赎回费中25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。（注：1年指365天）

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

（七）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

净申购金额 =申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50000/（1+1.5%）=49261.08元

申购费用=50000-49261.08=738.92元

申购份额=49261.08/1.05=46915.31份

即：投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则其可得到46915.31份基金份额。

2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额–赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额＝10000×1.148＝11480 元

赎回费用＝11480×0.5%＝57.40 元

净赎回金额＝11480－57.40＝11422.60 元

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

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

（八）申购与赎回的注册登记

1、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。

2、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。

3、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2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请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%时，即认为发生了巨额赎回。

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）接受全额赎回：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。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办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。依照上述规定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。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在 2 个工作日内通过指定媒体及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。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。

（十）拒绝或暂停申购的情形及处理

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市，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；

（5）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（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。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

（十一）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

（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；

（6）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（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，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告备案。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，延续期限不得超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。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至少一家指定媒体及基金管理人网站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，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

（十二）其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

（十三）基金转换

1、基金转换是指本基金管理人旗下的开放式基金持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为本基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他开放式基金的份额。

2、基金转换业务规则

（1）本基金管理人旗下基金办理日常转换的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本基金管理人公告暂停申购或转换时除外）。

由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，各销售机构办理基金转换业务的具体时间段及其他有关信息等事项，请以各销售机构的规定为准。

（2）基金转换只能在同一销售机构进行。

（3）转入的基金份额持有期自该部分基金份额登记于注册登记系统之日起开始计算。转入的基金在赎回或转出时，按照自基金转入确认日起至该部分基金份额赎回或转出确认日止的持有时段所适用的赎回费率档次计算其所应支付的赎回费。基金转换后可赎回的时间为 T＋2 日。

（4）基金转换，以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用“份额转换”的原则提交申请。基金转换遵循“先进先出”的原则。

（5）投资者办理基金转换业务时，转出的基金必须处于可赎回状态，转入的基金必须处于可申购状态，已冻结的基金份额不得申请基金转换。

（6）单笔转换基金份额不得低于 1000 份。

3、基金转换费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担，如转出基金有赎回费用的，收取该基金赎回费的 25%归入基金财产。

基金转换费用的具体计算公式如下：

（1）转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

（2）转入金额：

（i）如果转入基金的申购费率 ＞ 转出基金的申购费率，

转入金额＝转出金额×（1－转出基金赎回费率）/（1＋转入基金申购费率—转出基金申购费率）

（ii）如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率，

转入金额＝转出金额×（1-转出基金赎回费率）

(3)转换费用＝转出金额-转入金额

(4)转入份额 = 转入金额/转入基金当日基金份额净值

例：某客户将 10,000 份建信货币市场基金转换成本基金（假设本基金当日基金份额净值为 1.05 元）。建信货币的基金份额净值为 1 元，无累计未付收益。

因建信货币市场基金的赎回费率为 0%，申购费率为 0%，转入金额对应的本基金申购费率为 1.5%，则：

转出金额＝转出基金份额×转出基金当日份额净值=10,000×1＝10,000 元

转入金额＝转出金额×（1－转出基金赎回费率）/（1＋转入基金申购费率—转出基金申购费率）=10,000×（1－0%）/（1＋1.5%—0%）=9852.22 元

转换费用=转出金额-转入金额=10,000-9852.22=147.78 元

转入份额＝转入金额/转入基金份额净值=9852.22/1.05＝9383.07 份

即在上述情形下，该投资者将 10,000 份建信货币市场基金转换为本基金，经过注册登记机构确认后，投资者需要支付转换费用 147.78 元，转换后获得本基金基金份额为 9383.07 份。

4、本基金于 2010 年 7 月 19 日开始办理基金转换业务。

（十四）定期定额投资计划

基金定期定额投资（简称“基金定投”）指投资者可通过本基金管理人指定的基金销售机构提交申请,约定每期扣款时间和扣款金额，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

1、业务办理时间和销售机构

自 2010 年 7 月 19 日起，投资者可以通过本基金的直销机构和代销机构办理本基金的基金定投业务。基金定投的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购业务受理时间相同。

本基金的直销机构和代销机构的有关信息见本招募说明书 “销售机构”。

由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，各销售机构是否办理本基金定投业务及其他有关信息等事项，请以各销售机构的规定为准。

2、定投申购费率

如无特别说明，基金定投申购费率同正常申购费率。

3、投资金额

投资者可到销售机构各指定营业网点申请开办基金定投业务并约定每期扣款时间及固定的投资金额，该投资金额即为申购金额，每期申购金额不低于人民币 100 元(含 100 元)。

4、交易确认

每期实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日(T 日)的基金份额净值为基准计算申购份额，申购份额将在 T＋1 工作日确认成功后直接计入投资人的基金账户内。基金份额确认查询和赎回起始日为 T＋2 工作日。

为使您及时掌握定投申请的确认结果，请投资者在 T＋2 工作日起到本公司或代销机构各指定营业网点查询确认结果。

投资者办理本业务后，可以在本基金交易时间内随时办理基金的赎回。如无另行公告，本业务已申购份额的赎回及赎回费率等同于正常的赎回业务。赎回时遵循“先进先出”规则。

（十五）基金的非交易过户

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。

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”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的情形；“司法执行”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、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相关资料。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

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。

九、基金的投资

（一）投资目标

通过将绝大部分基金财产投资于上证社会责任 ETF，密切跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）标的指数

本基金的标的指数是上证社会责任指数。

上证社会责任指数用于反映上证公司治理板块中在社会责任的履行方面表现良好公司股票的走势，同时为投资者提供新的投资标的。该指数基日为 2009 年 6 月 30 日，基点为 1000 点，指数代码为 000048，指数简称为责任指数。上证社会责任指数是上证公司治理指数的主题衍生指数之一，指数样本股是在进行一定的流动性筛选后，从已披露社会责任报告的上证公司治理指数样本股中挑选 100 只每股社会贡献值最高的公司股票组成。

如果上证社会责任指数被停止编制及发布，或上证社会责任指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致上证社会责任指数不宜继续作为标的指数或本基金的目标 ETF——上证社会责任 ETF 变更标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人的同意后，更换本基金的标的指数和投资对象；并依据目标 ETF 的标的指数、市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象的，应符合有关法定程序，并在至少一种指定报刊和网站上公告。

（三）投资范围

本基金以上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任 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不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次

发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产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（包括但不限于指数衍生金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（四）投资理念

通过指数化投资与社会责任投资，以较低的成本获得市场平均水平的长期回报。

（五）目标 ETF 的投资

本基金的目标 ETF 为上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金，经 2010 年 3 月 26 日中国证券监督管理委员会证监许可[2010]378 号文核准募集。

目标ETF投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

目标 ETF 的投资范围、投资策略等内容以目标 ETF 的基金合同和招募说明书列示为准。

（六）投资业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。

随着市场环境的变化，如果标的指数不适用于本基金或投资的目标 ETF 变更标的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的标的指数，同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更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的媒体上刊登公告；若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

（七）投资策略

本基金为上证社会责任 ETF 的联接基金，主要通过投资于上证社会责任 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任 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。

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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、 资产配置策略

本基金主要投资于上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，保留现金或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%，然后主要通过一级市场将剩余的大部分资产投资于上证社会责任 ETF 并使该投资比例不低于基金资产净值的 90%，同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

2、 目标 ETF 投资策略

（1） 基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于指定的目标 ETF，现时目标 ETF 仅指上证社会责任 ETF。

（2） 基金组合的构建方法

本基金可以以成份股实物形式在一级市场申购及赎回上证社会责任 ETF 基金份额；本基金可在二级市场上买卖上证社会责任 ETF 基金份额，本基金在二级市场上买卖上证社会责任 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

本基金作为上证社会责任 ETF 的联接基金，主要通过成份股实物形式从一级市场申购 ETF 份额来构建 ETF 投资组合。不足一级市场最小申购赎回单位资产净值的部分可以从二级市场买入 ETF 份额或者投资于上证社会责任指数的成份股和备选成份股等。本基金在二级市场的 ETF 份额投资将不以套利为目的，作为被动投资的开放式基金，套利不符合本基金的投资特点和运作目的。

（3） 基金组合的调整

本基金为 ETF 联接基金，基金所构建的 ETF 投资组合将根据目标 ETF 的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、 成份股投资策略

（1） 股票组合的构建原则

成份股组合的构建主要是基金经理根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，以抽样复制法构建组合。

（2） 股票组合的构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行上证社会责任指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证社会责任指数的相关性等因素的基础上，采用重点抽样的方法，选择上证社会责任指数的成份股构建股票投资组合。考虑到个股权重集中度的因素，本基金主要投资于上证社会责任指数的前 5 大成份股，按照其在社会责任指数的原有比例分配权重后构成抽样组合。

（3） 股票组合的调整

1） 定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的上证社会责任指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

2） 不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替。

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。

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合，在一定的风险度下能提供最大的预期收益，或者在确定收益率上承担最小的风险。

5、 其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金的基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得用于投机交易目的。

6、 跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金跟踪误差的来源包括：留存现金及债券部分、成份股和备选成份股的投资、基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、股息的再投资策略等。基金管理人将通过对上述因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。

本基金每日跟踪基金组合与业绩比较基准表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与业绩比较基准表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

（八）投资管理体制及流程

1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、追踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

2、投资流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制。

（1）研究分析

研究部数量化研究小组依托公司研究平台，整合外部信息及外部研究力量的研究成果进行指数跟踪、成份股公司行为等信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策

投资决策委员会定期或不定期召开投资决策会议，根据法律法规、《基金合同》、研究报告以及基金监控指标和调整指标等确定基金投资组合是否需要进行调整以更好地跟踪标的指数，审批总体投资方案及重大投资事项。

基金经理根据标的指数，结合研究报告，原则上依据指数成份股的权重构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将根据投资决策委员会确定的投资组合调整方案采取适当的方法调整组合，以降低交易成

本、控制投资风险。对于超出权限范围的投资，基金经理按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

（3）交易执行

交易部接收到基金经理下达的交易指令后，首先应对指令予以审核，然后具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

（4）投资回顾

风险管理部定期对基金的绩效进行评估，并对基金的跟踪误差、跟踪偏离度、信息比率、流动性风险等进行评估。同时，评估信息将以绩效评估报告的形式及时反馈至投资决策委员会、监察稽核部、投资管理部等相关部门，为制定和调整投资策略、评估风险水平提供依据。

（九）基金的风险收益特征

本基金为上证社会责任 ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

（十）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，但法律法规或中国证监会另有规定的和指定的目标 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，但是指定的目标 ETF 除外；

（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

基金管理人运用基金财产进行证券投资，遵守下列限制：

（1） 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；

（2） 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；

（3） 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（4） 本基金投资于上证社会责任ETF的资产比例不低于基金资产净值的 90%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%；

（5） 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

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

（7） 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全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 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；

（8） 本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上；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%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

（十一）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。

（十二）基金管理人代表基金行使股东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。

（十三）基金的投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2010 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

11.1 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	395,103,740.08	48.04
	其中：股票	395,103,740.08	48.04
2	基金投资	298,650,000.00	36.31
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	128,092,736.51	15.57
7	其他各项资产	626,893.44	0.08
8	**合 计**	**822,473,370.03**	**100.00**

11.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	建信基金管理有限责任公司	298,650,000.00	36.63

11.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	43,936,260.66	5.39
C	制造业	88,596,198.86	10.87
C0	食品、饮料	3,010,082.91	0.37
C1	纺织、服装、皮毛	4,160,054.05	0.51
C2	木材、家具	355,411.18	0.04
C3	造纸、印刷	1,154,433.00	0.14
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,982,804.26	0.86
C5	电子	3,053,633.27	0.37
C6	金属、非金属	19,825,817.12	2.43
C7	机械、设备、仪表	38,651,586.23	4.74
C8	医药、生物制品	11,034,417.65	1.35
C99	其他制造业	367,959.19	0.05
D	电力、煤气及水的生产和供应业	238,064.19	0.03
E	建筑业	20,249,622.89	2.48
F	交通运输、仓储业	7,425,986.62	0.91
G	信息技术业	20,587,114.69	2.52
H	批发和零售贸易	9,594,658.96	1.18
I	金融、保险业	188,701,451.79	23.14

J	房地产业	13,201,696.28	1.62
K	社会服务业	2,572,685.14	0.32
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合 计	**395,103,740.08**	**48.46**

11.4 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	601318	中国平安	772,714	40,868,843.46	5.01
2	600036	招商银行	2,754,965	35,676,796.75	4.38
3	601328	交通银行	4,648,483	26,961,201.40	3.31
4	600016	民生银行	5,072,959	25,872,090.90	3.17
5	601166	兴业银行	968,547	22,392,806.64	2.75
6	600000	浦发银行	1,551,847	20,111,937.12	2.47
7	601088	中国神华	752,413	17,764,470.93	2.18
8	600030	中信证券	1,580,618	16,817,775.52	2.06
9	600104	上海汽车	596,614	10,052,945.90	1.23
10	600050	中国联通	1,905,551	9,680,199.08	1.19

11.5 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。

11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

11.7 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。

11.8 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。

11.9 投资组合报告附注

11.9.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

11.5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	552,706.69
4	应收利息	26,896.11
5	应收申购款	47,290.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	**合　计**	**626,893.44**

11.9.4 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。

11.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受。

十、基金的业绩

基金业绩截止日为 2010 年 9 月 30 日。

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

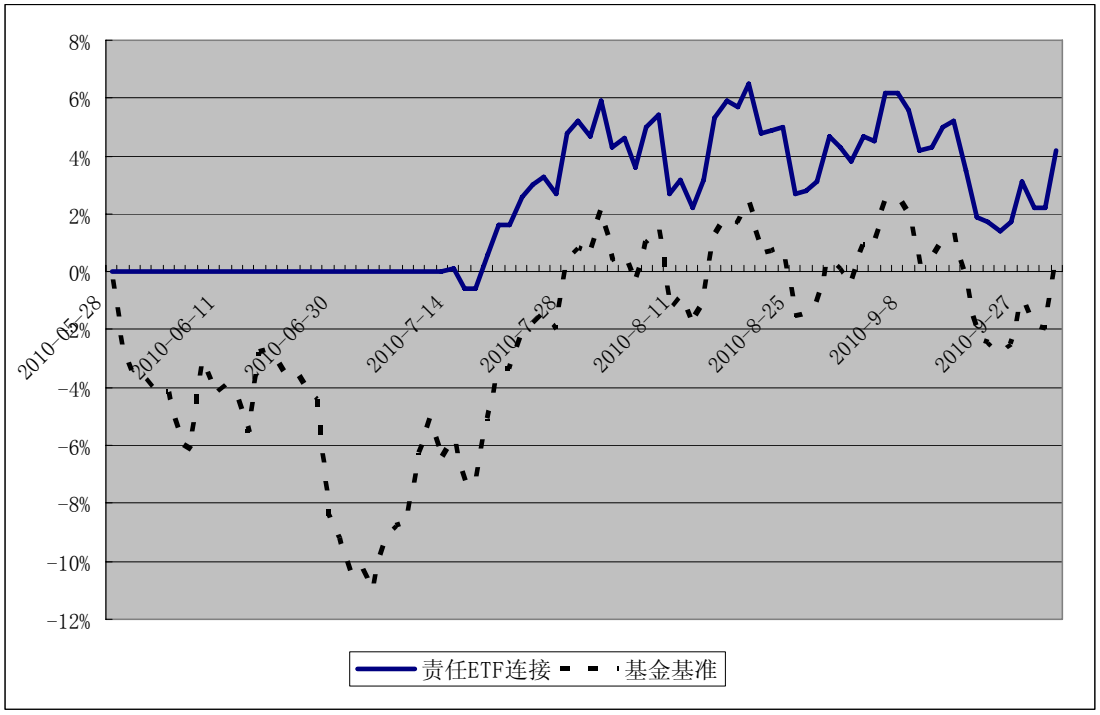
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效之日 2010 年 5 月 28 日至 2010 年 9 月 30 日	4.20%	0.83%	0.20%	1.35%	4.00%	-0.52%

2、自基金合同生效以来基金份额净值及其业绩比较基准的变动情况

建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010 年 5 月 28 日至 2010 年 9 月 30 日）



注：

1、截至本报告期，本基金基金合同生效不满一年。

2、本基金以上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任 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不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产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（包括但不限于指数衍生金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

十一、基金的财产

（一）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、结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。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由

基金托管人保管。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、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销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消；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消。

十二、基金资产的估值

（一）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的价值，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。

（二）估值日

基金资产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。

（三）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。

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），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，以及停止交易、但未行权的权证，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资产净值，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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（四）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。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以电子或者加盖公章的书面形式加密发送至基金托管人，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，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章或者以电子签名确认的方式返回给基金管理人；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。

（六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值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，并报中国证监会备案。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、或注册登记机构、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发生的差错，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资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。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，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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并报中国证监会备案。

（七）暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

5、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

6、中国证监会认定的其他情形。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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。

十三、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

在本基金《基金合同》项下，基金收益即基金利润是指基金利息收入、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收益减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

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

（三）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 4 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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）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。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，报中国证监会备案后在权益登记日前2日于指定媒体及基金管理人网站上公告。

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。

（六）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；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

十四、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

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） 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

（4） 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

（5） 基金份额持有人大会费用；

（6） 基金的证券交易费用；

（7） 基金的银行汇划费用；

（8） 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、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5%年费率计提基金管理费。计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

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的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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

本基金基金财产中投资于目标 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剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提基金托管费。计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

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的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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。

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，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 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站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。

本条第 1 款第（3）至第（8）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。

（二）基金销售时发生的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中的相关规定。本基金申购费、赎回费的费率水平、计算方式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的相关规定。不同基金间转换的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定确定并公告。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，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。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的会计责任方。

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。

（二）基金年度审计

1、本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和基金托管人同意，并报中国证监会备案。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

十六、基金的信息披露

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。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。

（一）公开披露的基金信息

1、招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

2、基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

3、基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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。

4、基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

5、基金资产净值公告、基金份额净值公告

（1）本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

（2）基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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；

（3）基金管理人将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述最后一个市场交易日的次日，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报刊和网站上。

6、基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

（1）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报刊上。基金年度报告的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

（2）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报刊上；

（3）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报刊和网站上。

8、临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

（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） 变更目标 ETF；

（5） 更换基金管理人、基金托管人；

（6） 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7） 基金管理人股东及其出资比例发生变更；

（8） 基金募集期延长；

（9） 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；

（10） 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

（11） 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 30%；

（12） 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

（13） 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

（14） 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；

（15） 重大关联交易事项；

（16） 基金收益分配事项；

（17） 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（18） 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

（19） 基金改聘会计师事务所；

（20） 变更、增加、减少基金份额代销机构；

（21） 更换基金注册登记机构；

（22） 本基金开始办理申购、赎回；

（23） 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

（24） 本基金发生巨额赎回并延期支付；

（25） 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

（26） 本基金暂停接受申购、赎回申请；

（27） 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

（28） 基金推出新业务或服务；

（29） 中国证监会规定的其他事项。

9、澄清公告

在本基金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。

10、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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

11、中国证监会规定的其他信息。

（二）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在至少一种指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十七、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（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数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。

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。

因拆分、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。以 1.00 元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至 1.00 元初始面值或 1.00 元附近，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，由投资者自行负担。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

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。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

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，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

（二）管理风险

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

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

（四）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

（五）投资本基金的特有风险

1、目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金，主要投资对象是目标 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。

2、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。标的指数成份股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。

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

（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；

（4）在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力，例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出证券的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金相对于对标的指数的偏离程度。

5、本基金为目标 ETF 的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生差异的原因包括以下几个方面：

（1）本基金赎回采用现金方式，为支付现金赎回款，相比目标 ETF，本基金需要保留更多的现金资产；

（2）本基金申购采用现金方式，在利用到账的申购资金投资目标 ETF 过程中，市场波动等原因会造成本基金与目标 ETF 表现的差异；

（3）本基金为应对现金申购赎回而进行的证券交易需支付一定的手续费，此等费用将影响本基金相对于目标 ETF 的表现。

（六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

十八、基金的终止与清算

（一）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的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止情形发生时，应当按法律法规和本基金基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、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。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。

3、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。

4、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。

5、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止后，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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

（三）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。

（四）基金剩余资产的分配

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。

（五）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。

（六）基金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。

十九、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：江先周

成立时间：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]158 号

组织形式:有限责任公司

注册资本：人民币 2 亿元

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：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：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

3、基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上

书面签章或签字为必要条件。

4、基金管理人的权利与义务

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

1）依法募集基金；

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

7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8）选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销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注册登记机构办理基金注册登记业务；

10）依据《基金合同》及有关法律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）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整相关业务规则，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

13）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；

14）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、融券；

15）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；

16）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；

17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

1）依法募集基金，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）编制半年度和年度基金报告；

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

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

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

14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件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。

5、基金托管人的权利与义务

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

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

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

3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《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）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算；

6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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；如果基金管理人有未执行《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）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；

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。

6、基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的合法权益。

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

1）分享基金财产收益；

2）参与分配清算后的剩余基金财产；

3）依法申请赎回其持有的基金份额；

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本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会，对本基金基金份额持有人大会或目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7）监督基金管理人的投资运作；

8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

1）遵守《基金合同》；

2）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；

3）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；

4）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；

5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及

代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

6）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1、召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

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；

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

12） 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

（2）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；

4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5）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；

6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、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。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。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、方式和会议形式；

2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

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）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

5）会务常设联系人姓名及联系电话；

6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

7）召集人需要通知的其他事项。

（2）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面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书面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书面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。

4、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，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书

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及身份证明、受托出席会议者身份证明及其出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2)经核对，汇总到会者出示的在权利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》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，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书符合法律法规、《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。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）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 天前提交召集人并由召集人公告。

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日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1）关联性。大会召集人对于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进行解释和说明。

2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）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，如果需要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。

（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。

6、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，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，符合会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面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。

7、计票

（1）现场开会

1）基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布选举三名监票人，其中至少有两名监票人从出席会议的基金份额持有人和代理人中选举产生。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书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

8、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 个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。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。

9、关于本基金的基金份额持有人出席目标 ETF 的份额持有人大会并参与表决的特别约定

鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，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，其在目标 ETF 份额持有人大会上享有表决权的基金份额称为目标 ETF 参会份额。本基金份额持有人所持每份目标 ETF 参会份额对应目标 ETF 的一票表决权，参会份额数的计算方法为：目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日当日，本基金持有目标 ETF 份额占本基金基金资产的比例乘以该持有人所持有的本基金份额数（计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位）。

10、法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

（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 4 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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、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。

3、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，报中国证监会备案后在权益登记日前2日于指定媒体及基金管理人网站上公告。

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。

4、基金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；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

（四）与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。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剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5%年费率计提基金管理费。计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

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的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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

本基金基金财产中投资于目标 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剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1%年费率计提基金托管费。计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

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的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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。

（五）基金资产的投资范围

本基金以上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任 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不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融

工具，该部分资产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（包括但不限于指数衍生金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（六）基金资产的投资限制

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，但法律法规或中国证监会另有规定的和指定的目标 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，但是指定的目标 ETF 除外；

（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） 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；

（2） 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；

（3） 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（4） 本基金投资于上证社会责任 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%；

（5） 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

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

（7） 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全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 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；

（8） 本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上；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%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调

整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

（七）基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

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。

1、基金资产净值的计算方式

本基金的估值对象为基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

本基金的估值日为相关的证券交易场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。

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。

（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），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，以及停止交易、但未行权的权证，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资产净值，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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

2、基金资产净值的公告方式

本基金合同生效后，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、基金份额销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报刊和网站上。

（八）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

（1）以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

1）更换基金管理人；

2）更换基金托管人；

3）转换基金运作方式；

4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

5）变更基金类别；

6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

7）本基金与其他基金的合并；

8）变更基金份额持有人大会程序；

9）终止《基金合同》；

10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，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：

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；

4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5）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；

6）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（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，自该决议生效之日起在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

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的；

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

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

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

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

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

（4）基金财产清算程序：

1）《基金合同》终止后，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。

（5）基金财产清算的期限为 6 个月。

（6）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。

（7）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。

（8）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。

（9）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。

（九）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，仲裁的地点在北京，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。

《基金合同》受中国法律管辖。

（十）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1.基金管理人

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：江先周

成立时间：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158 号文

注册资本：2 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售，资产管理和中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

电话：010-66228888

传真：010-66228889

联系人：路彩营

2.基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

电话：010-66106912

传真：010-66106904

联系人：蒋松云

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金投资于上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股、新股（包括创业板新股）、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于指数衍生金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述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：

本基金以上证社会责任 ETF、上证社会责任指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于上证社会责任 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不低于基金资产净值的 5%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

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) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股不受此限；

b) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但标的指数成份股不受此限；

c) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

d) 本基金投资于上证社会责任 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括创业板新股）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%；

e) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

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

g) 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全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 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；

h) 本基金持有的资产支持证券的信用级别均在 BBB 级以上；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%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资

基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

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。

（3）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

a）承销证券；

b）向他人贷款或提供担保；

c）从事承担无限责任的投资；

d） 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的和指定的目标 ETF 除外；

e） 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；

f） 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，但是指定的目标 ETF 除外；

g）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；

h）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。

（4）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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。

（5）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

①基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对

手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

③基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

（6）基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于

存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

（7）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

①基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

②流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

③基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式进行确认。

④基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

⑤基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行

补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

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监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反有关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须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。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，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。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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，并予协助配合。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，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

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。未经基金管理人的正当指令，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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的建信基金管理有限责任公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，

代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，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；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人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公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

5、债券托管账户的开立和管理

（1）《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自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。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。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

（五）基金资产净值计算与复核

1．基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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该计算日基金总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》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工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以电子或者加盖公章的书面形式加密发送至基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务

公章或者以电子签名确认的方式返回给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，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，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。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。

2．基金资产估值方法

（1）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。

（2）估值方法

本基金的估值方法为：

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。

②证券交易所上市的有价证券的估值

A、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、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。

B、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；

C、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；

D、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：

A、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。

B、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。

C、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，以及停止交易、但未行权的权证，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。

3．估值差错处理

因基金估值错误给基金份额持有人造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

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。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括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由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基

金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

（七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，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，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。公司承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，积极增加服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

（一）客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）、010-66228000

1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金净值查询、账户信息查询、公司信息查询、基金信息查询等。

2、人工咨询服务

客户服务中心提供每周一至每周五，上午 9：00～11：30，下午 13：00～17：00 的人工电话咨询服务。

3、客户留言服务

投资者可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知公司客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

（二）邮寄服务

若投资者准确完整的预留了地址及邮编，我公司将提供以下邮寄服务：

1、账户确认书

客户服务中心于投资者开户确认后，在 15 个工作日内安排寄出。

2、交易对账单

客户服务中心于每季度结束后，在 15 个工作日内安排为基金持有人寄出。

3、对账单补寄

客户服务中心于投资者提出补寄需求后，在 15 个工作日内安排寄出。

4、其他相关信息资料

为加强与投资者沟通，使投资者及时了解公司最新动态及产品信息，客户服务中心将不定期为客户寄送相关信息资料。

（三）网站服务（www.ccbfund.cn）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、公司动态及相关信息等。

2、账户查询：投资者可通过网上“账户查询”服务查询账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资者还可通过“账户查询修改”、“查询密码修改”自助修改基本信息及查询密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷的下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好的了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资者的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

（四）短信服务

1、若投资者准确完整的预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆公司网站添加后定制此项服务。

2、短信对账单：短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信对账单服务的持有人发送短信对账单。

（五）电子对账单服务

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。

我公司在每月度结束后10个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的持有人发送电子对账单。

（六）密码解锁/重置服务

为保证投资者账户信息安全，当拨打客服电话或登陆公司网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达 6 次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

（七）客户建议、投诉处理

投资者可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信、传真等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

二十二、其他应披露事项

自2010年5月28日至2010年11月27日，本基金的临时公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站www.ccbfund.cn。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于运用固有资金投资公司旗下开放式基金的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年11月18日
2	关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年11月16日
3	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年11月10日
4	关于旗下部分开放式基金继续参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年9月29日
5	关于旗下部分基金继续参加齐鲁证券开放式基金网上交易费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年8月27日
6	关于旗下部分开放式基金参加农业银行借记卡基金网上直销定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年8月26日
7	关于旗下开放式基金参加农业银行“天天e拍”活动暨农行借记卡基金网上直销申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年8月20日
8	关于旗下部分开放式基金参加华泰联合证券基金网上交易费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010年8月5日

9	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 8 月 5 日
10	关于旗下部分开放式基金参加信达证券非现场委托方式基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 8 月 4 日
11	关于旗下开放式基金通过信达证券开办基金定投业务暨参加信达证券网上交易系统定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 8 月 4 日
12	关于旗下部分开放式基金通过安信证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 29 日
13	关于旗下部分开放式基金参加建设银行定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 20 日
14	关于建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金参加交通银行基金定投业务优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 20 日
15	关于参加中国建设银行电子银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 20 日
16	关于建信上证社会责任 ETF 联接基金开放定投、转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 15 日
17	关于新增上海证券、红塔证券为建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 15 日
18	联接基金开放申购业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 12 日

19	开放赎回业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 8 日
20	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 7 月 1 日
21	关于开通民生银行借记卡基金网上交易业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 6 月 24 日
22	建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2010 年 5 月 29 日

投资者可通过中国证券报、上海证券报、证券时报和基金管理人网站www.ccbfund.cn查阅上述公告。

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

1、中国证监会核准建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

2、《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

3、《建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

4、关于申请募集建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金之法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年一月十一日