广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书

(上接 22 版)

注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
法定代表人:林卓
联系人:薛长平
电话:0411-88891212
传真:0411-88891212
客服电话:4006411999
公司网址:www.haojiyoujijin.com
(31)名称:北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址:北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
联系电话:010-52703350-6006
业务传真:010-62020355
客服热线:4008886661
公司网址:www.myfund.com
(32)名称:中信期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人:张皓
联系人:洪诚
电话:0755-23953913
传真:0755-83217421
客服电话:4009908826
公司网址:www.citicsf.com
(33)名称:包商银行股份有限公司
注册地址:内蒙古包头市钢铁大街 6 号
办公地址:内蒙古包头市钢铁大街 6 号
法人代表:李镇西
联络人:刘芳
联系电话:95352
客服电话:内蒙古地区:0472-96016
北京地区:010-96016
宁波地区:0574-967210
深圳地区:0755-967210
成都地区:028-65558555
传真:0472-5189057
网址: www.bsb.com.cn
(34)名称:北京农村商业银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街九号
办公地址:北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座
法定代表人:乔瑞
联系人:王薇娜
联系电话:010-63229475
传真:010-63229763
客服电话:010-96198
公司网站:www.bjrcb.com
(35)名称:渤海银行股份有限公司
住所:天津市河西区马场道 201-205 号
法定代表人:李伏安
联系人:王宏
电话:022-58316666
传真:022-58316569
客户服务热线:95541
公司网站:www.cbhb.com.cn
(36)名称:天津银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区友谊路 15 号
办公地址:天津市河西区友谊路 15 号
法定代表人:王金龙
联系人:杨森
电话:022-28405330
传真:022-28405631
客服电话:4006-960296
公司网站:www.bank-of-tianjin.com
(37)名称: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
办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人:黄金琳
联系人:王虹
电话:021-20655183
传真:021-20655196
公司网站:www.hfzq.com.cn
(38)名称:爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼
法定代表人:钱华
联系人:王薇
联系电话:021-32229888
业务传真:021-68728703
客服热线:4001-962502
公司网址:www.ajzq.com
(39)名称:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路 98 号
办公地址:上海市广东路 689 号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务热线:95553 或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com
(40)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路 1 号
办公地址:杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6-7 层
法定代表人:吴承
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn
(41)名称:中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路 86 号
办公地址:济南市经七路 86 号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531 - 68889155
传真:0531 - 68889752
客服电话:95538
公司网站:www.zts.com.cn
(42)名称:德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址:上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼
法定代表人:姚文平
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客服电话:400-8888-128
公司网站:www.tebon.com.cn
(43)名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客服电话:4008888788,10108998,95525
公司网站:www.ebscn.com
(44)名称:东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(45)名称:国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市金融一街 8 号
办公地址:无锡市滨湖区太湖新城金融一街 8 号
法定代表人:姚志勇
联系人:祁昊
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客服电话: 95570
公司网站:www.glsc.com.cn
(46)名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
公司网站:www.dwzq.com.cn
(47)名称:华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路 8 号
法定代表人:俞洋
联系人:杨莉娟
联系电话:021-54967202
业务传真:021-54967293
客服热线:021-32109999;029-68918888;4001099918
(48)名称:华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
联系电话:0551-65161821
客服电话:96518
公司网站:www.hazq.com
(49)名称:申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
法定代表人:李梅
联系人:李玉婷
联系电话:021-33388229
客户服务电话:95523、4008895523
传真:021-33388224
网址:www.swhysc.com
(50)名称:申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
法定代表人:韩志谦
联系人:王怀春
联系电话:0991-2307105
客户服务电话:400-800-0562
传真:010-88085195
网址:www.hysec.com
(51)名称:中航证券有限公司
住所:南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
电话:400-886-6567
传真:0791-86770178
公司网站:www.avicsec.com
(52)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层
办公地址:上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
电话:021-50122086
传真:021-50122200
客服电话:4008209898
公司网站:www.cnhbstock.com
(53) 公司名称:南京证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路 389 号
法定代表人:步国旬
联系人:王万君
联系电话:025-58519523
客户服务电话:95386
传真:025-83369725
网址:www.njzq.com.cn
(54)名称:徽商期货有限责任公司
注册地址:合肥市芜湖路 258 号
办公地址:合肥市芜湖路 258 号
法定代表人:吴国华
联系人:蔡芳
联系电话:0551-62862801
业务传真:0551-62862801
客服热线:4008878707
公司网址:www.hsqh.net
(55)名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801
法定代表人:汪静波
联系人:方成
联系电话:021-38600735
业务传真:021-38509777
客服热线:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com
(56)名称:海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
业务传真:021-80133413
客服热线:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com
(57)名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人:张跃伟
联系人:佘晓峰
电话:021-20691836
传真:021-20691861
客服电话:400-820-2899
公司网站:www.erichfund.com
(58)名称:浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心 1 号楼(D 区)801 室
办公地址:浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心 1 号楼(D 区)801 室
法定代表人:陆彬彬
联系人:邓秀男
联系电话:0571-56028620
业务传真:0571-56899710
客服热线:400 068 0058
公司网址:www.jincheng-fund.com
(59)名称:上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人:沈继伟
联系人:张裕
联系电话:15801816961
客服热线:4000676266
公司网址:www.leadfund.com.cn
(60)名称:上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com
(61)名称:江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵中路 668 号
办公地址:江苏省常州市延陵中路 668 号
法人代表:王国琛
联系人:续志刚
联系电话:0519-89995001
客服电话:0519-96005
传真:0519-89995001
网址:www.jnbank.cc
(62)名称:泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市云鹿路 3 号
办公地址:泉州市云鹿路 3 号
法定代表人:傅子能
联系人:董培姗
联系电话:0595-22551071
业务传真:0595-22505215
客服热线:4008896312
公司网址:www.qzccbank.com
(63)名称:上海农商银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
法定代表人:冀光恒
联系人:施传荣
联系电话:021-385766666
业务传真:021-50105124
客服热线:962999
公司网址:www.srcb.com
(64)名称:天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座
法人代表:余磊
联系人:翟璟
联系电话:027-87618882
客服电话:4008005000
传真:027-87618863
公司网址: www.tfzq.com
(65)名称:宁波银行股份有限公司
住所:宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
联系方式:0574-89068340
传真:0574-87050024
客服电话:96528,上海、北京地区 962528
公司网站:www.nbcb.com.cn
(66)名称:徽商银行股份有限公司
住所:安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座
法定代表人:王晓昕
联系人:叶卓伟
电话:0551-2667635
传真:0551-2667684
客服电话:4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)
公司网站:www.hsbank.com.cn
(67)名称:财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼
法定代表人:蔡一兵
联系人:郭磊
电话:0731-84403319
公司网站:www.cfzq.com
(68)名称:国金证券股份有限公司
办公地址:四川省成都市东城根上街 95 号
客服电话:95310
公司网站:www.gjzq.com.cn
联系人:刘婧漪、贾鹏
联系电话:028-86690057、028-86690058
传真号码:028-86690126
(69)名称:第一创业证券股份有限公司
通讯地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼
法定代表人:刘学民
传真: 0755-23838750
联系人:毛诗莉
客服电话:95358
公司网站:www.firstcapital.com.cn
(70)名称:联讯证券股份有限公司
注册地址:惠州市惠城区江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大厅和三、四层
法定代表人:徐刚
客服电话:95564
联系人:彭莲
公司网址:www.lxsec.com
(71)名称:平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层;
办公地址:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层;
法定代表人:曹实凡
全国免费业务咨询电话:95511-8
开放式基金业务传真:0755-82400862
全国统一总机:95511-8
网址:www.pingan.com
(72)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn
(73)名称:中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
法定代表人:吴永良
联系人:刘军
联系电话:0755-82943755
业务传真:0755-82940511
客服热线:4001022011
公司网址:www.zszq.com
(74)名称:东莞证券股份有限公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼
法人代表:张运勇
联系人:乔芳
联系电话:0769-22100155
客服电话:0769-961130
传真:0769-22119426
公司网址:www.dgzq.com.cn
(75)名称:广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼
法定代表人:刘东
联系人:林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客服电话:95396
公司网站:www.gzs.com.cn
(76)名称:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦六楼
法定代表人:何如
联系人:周杨
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn
(77)名称:招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
客服电话:95565、4008888111
公司网站:www.newone.com.cn
(78)名称:长城证券股份有限公司
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:黄耀华
联系人:刘阳
电话:0755-83516289
传真:0755-83515567
客户服务热线:0755-33680000;400-6666-888
公司网站:www.cgws.com
(79)名称:万联证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层
办公地址:广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-8888-133
联系人:甘蕾
联系电话:020-38286026
公司网站:www.wlzq.cn
(80)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
统一客服电话:4008001001
公司网站:www.essence.com.cn
(81)名称:长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客服电话:955679 或 4008888999
联系人:李良
电话:07-65799999
传真:027-85481900
客服网站:www.95579.com
(82)名称:国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路 88 号(江信国际金融大厦)
办公地址:南昌市北京西路 88 号(江信国际金融大厦)
法定代表人:徐丽峰
联系人:周欣玲
电话:0791-86281305
传真:0791-86282293
客服电话: 4008-222-111
公司网站:www.gsstock.com
(83)名称:深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
客服热线:4006-788-887
(84)名称:东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址:东莞市东城区鸿福东路 2 号
办公地址:东莞市东城区鸿福东路 2 号
法定代表人:何沛良
联系人:何茂才
电话:0769-22866255
传真:0769-22866282
客服电话:961122
公司网站:www.drcbank.com
(85)名称:广州农村商业银行股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城华夏路 1 号信合大厦
办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路 1 号信合大厦
法定代表人:王继康
联系人:杨华
联系电话:020-28019593
业务传真:020-28852692
客服热线:020-961111
公司网址:www.grcbank.com
(86)名称:广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号
办公地址:广东顺德区大良街道办事处德和居委会拥翠路 2 号
法定代表人:吴海恒
联系人:何浩华
电话:0757-22388928
传真:0757-22388235
客服电话:0757-22223388
网址:www.sdebank.com
(87)名称:广东南海农村商业银行股份有限公司
注册地址:广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号
办公地址:广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 26 号
法定代表人:肖寒
联系人:廖雪
联系电话:0757-86266566
业务传真:0757-86250627
客服热线:96138
公司网址:www.nanhaibank.com
(88)名称:东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市运河东一路 193 号
办公地址:东莞市运河东一路 193 号
法定代表人:廖玉林
联系人:巫渝峰
电话:0769-22100193
传真:0769-22117730
客服电话:40011-96228
公司网站:www.dongguanbank.cn
(89)名称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人:王莉
联系人:吴阿婷
联系电话:0755-82721106-8642
业务传真:0755-82029055
客服热线:4009200022
公司网址:www.hexun.com
(90)名称:众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201
法定代表人:李招弟
联系人:高晓芳
联系电话:010-59393923
业务传真:010 -59393074
客服热线:400-876-9988
公司网址:www.zscffund.com
(91)名称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
业务传真:021-64385308
客服热线:4001818188
(92)名称:上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
公司网址:www.lufunds.com
(93)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
联系电话:0571-88911818-8565
业务传真:0571-86800423
客服热线:0571-88920897、4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
(94)名称:北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元
法定代表人:胡伟
联系人:姜颖
电话:010-65951887
客服电话:4006180707
公司网址:www.hongdianfund.com
(95)名称:上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层
办公地址:上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7-9 层
法定代表人:冯修敏
联系人:云卉
电话:021-33323999-5611
传真:021-33323837
客服电话:400-820-2819
公司网址:https://tty.chinapnr.com
(96)名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
业务传真:021-68596916
客服热线:4007009665
公司网址:www.ehowbuy.com
(97)名称:珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏嫦
电话:020-89629019
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.cn
(98)名称:蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
联系电话:021-60897840
业务传真:0571-26697013
客服热线:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn
(99)名称:北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:吴季林
电话:010-61840688
传真:010-61840699
客服电话:4000618518
公司网址:https://danjuanapp.com
(100)名称:南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:钱燕飞
联系人:王锋
电话:025-66996699-887226
传真:无
客电话:4008365365-9
公司网址:www.Fund.licai.com
(101)名称:北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室
办公地址:北京市朝阳区望京宏泰东街 浦项中心 B 座 19 层
法定代表人:齐剑辉
联系人:王英俊
电话:13911468997
传真:010-82055860
客服电话:4006236060
公司网址:www.niuniufund.com
(102)名称:奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
公司电话:0755-89460500
传真号码:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
(103)名称:北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15
办公地址:北京经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部大楼 A 区 17 层
法定代表人:陈超
联系人:江卉
电话:13141319110
传真:010-89188000
客服电话:400-088-8816
公司网址:http://jr.jd.com/
(104)名称:上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼
法定代表人:陈灿辉
联系人:021-63898427
电话:徐璐
客服电话:400-820-5999
网址:www.shhxzq.com
(105)名称:青岛银行股份有限公司
注册地址:山东省青岛市市南区香港中路 68 号
法定代表人:郭少泉
联系人:滕克
联系电话:0532-85709787
传真:0532-85709799
客服电话:(青岛)96588,(全国)400-66-96588
公司网站:www.qdccb.com
(106)名称:上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客服电话:4008-205-369
公司网址:www.jiyufund.com.cn
(107)名称:湘财证券股份有限公司
注册地址:长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼
法定代表人:林俊波
联系人:李欣
电话:021-38784580
传真:021-68865680
公司网站:www.xcsc.com
(108)名称:国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
办公地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人:王少华
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com
(109)名称:太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层
办公地址:北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元
法定代表人:李长伟
联系人:陈征
联系电话:010-88321882
业务传真:010-88321763
客服热线:0871-68898130
公司网址:www.tpyzq.com
(110)名称:国融证券股份有限公司
注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层
法定代表人:张智河
联系人:叶密林
联系电话:010-83991719
业务传真:(010)66412537
客服热线:95385
公司网址:www.grzq.com
(111)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层
法定代表人:杨懿
联系人:张燕
联系电话:010-58325388-1588
业务传真:010-58325282
客服热线:400-166-1188
公司网址:http://8.jrj.com.cn
(112)名称:上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法定代表人:王廷富
联系人:姜吉灵
电话:021-5132 7185
传真:021-5071 0161
客服电话:400-821-0203
(113)名称:中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层 -21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
开放式基金咨询电话:95532、400-600-8008
公司网站:www.china-invs.cn
(114)名称:上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元
法定代表人:申健
联系人:印强明
电话:021-20219188
传真:021-20219923
客服电话:021-20219931
公司网址:https://8.gw.com.cn/
(115)名称:兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路 99 号标力大厦
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565955
客户服务热线:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn
(116)名称:北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:4006199059
公司网址:www.hcjijin.com

3、其他代销机构

本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

二、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-56 室
法定代表人:孙树明
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31 - 33 楼
电话:020-89188970
传真:020-89899175
联系人:李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市盈科(广州)律师事务所
住所: 广州市广州大道中 289 号南方传媒大厦 B 座 15-18 层
负责人:牟晋军
电话:020 - 66857288
传真: 020 - 66857289
经办律师:刘智、陈琛
联系人:牟晋军

四、审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
法人代表:卢伯卿
联系人:洪锐明
电话:021 - 61418888
传真:021 - 63350003
经办注册会计师:王明静、吴迪

第六部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定募集本基金,并经 2016 年 12 月 16 日中国证监会证监许可[2016]3127 号文以及 2017 年 11 月 3 日中国证监会证券基金机构监管部《关于同意广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金延期募集备案的函》(机构部函[2017]2525 号)准予募集注册。

一、基金运作方式

契约型开放式。

二、基金类型

ETF 联接基金。

三、基金存续期限

不定期。

四、本基金与目标 ETF 的联系与区别

本基金为目标 ETF 的联接基金,二者既有联系也有区别:

(1)在投资方法方面,目标 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的方法,通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(2)在交易方式方面,投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标 ETF,也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求,申赎目标 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"原则进行基金的申购与赎回。

本基金与目标 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。目标 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,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,仍需保留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。

(2)申购赎回的影响。目标 ETF 采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式,大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

五、募集方式与募集期限

本基金的募集方式为代销与直销。募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月,具体发售时间见基金份额发售公告。如果在此期间未达到本招募说明书第七部分第一款规定的基金备案条件,基金可在募集期限内继续销售,直到达到基金备案条件。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。

本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购,认购一旦被注册登记机构确认,就不再接受撤销申请。

基金发售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

六、募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点向社会公开募集。办理开放式基金业务的城市(网点)的具体情况和联系方法,请参见本基金之发售公告。

七、发起资金的认购

基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员认购本基金的发起资金金额不少于 1000 万元人民币,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年(基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外),其中,发起资金持有期限自该基金公开发售之日或者合同生效之日孰晚日起计算,法律法规或证监会另有规定的除外。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

八、募集规模

本基金的最低募集份额总额为 1000 万份,最低募集金额为 1000 万元人民币。

本基金不设首次募集目标上限。

九、基金的份额类别设置

本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用,而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为:计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值 / 计算日该类基金份额余额总数

基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定,并在招募说明书中公告。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据基金销售情况,在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人利益的情况下,基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者在法律法规和基金合同规定的范围内对现有基金份额类别变更申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等。调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

十、基金份额发售面值、认购价格和认购费用

1、份额发售面值:人民币 1.00 元

2、认购价格:人民币 1.00 元

3、认购费用:

本基金 A 类基金份额在认购时收取基金认购费用,C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类基金份额对认购设置级差费率,认购费率随认购金额的增加而递减,最高认购费率不超过 1.00%,投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算,具体费率如下:

认购金额(M)	认购费率
M<100 万元	1.00%
100万元≤M<500 万元	0.60%
M≥500 万元	每笔 1,000 元

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

4、认购份额的计算

(1)若投资者选择认购本基金 A 类份额,认购份额的计算方法如下:

净认购金额 = 认购金额 /(1+认购费率)

或,净认购金额=认购金额 – 固定认购费金额

认购费用 = 认购金额 – 净认购金额

或,认购费用 = 固定认购费金额

认购份额 =(净认购金额+认购期利息)/ 基金份额发售面值

认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位;认购份额计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资人投资 10,000 元认购本基金 A 类份额,如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元,则其可得到的 A 类基金份额计算如下:

净认购金额 =10,000/(1+1.00%)=9,900.99 元

认购费用 =10,000 – 9,900.99 =99.01 元

认购份额 =(9,900.99+5)/1.00 =9,905.99 份

即投资人投资 10,000 元认购本基金的 A 类基金份额,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到 9,905.99 份 A 类基金份额。

(2)若投资者选择认购本基金 C 类份额,认购份额的计算方法为:

认购份额 =(认购金额 + 认购期利息)/ 基金份额发售面值

例:某投资者投资 10,000 认购本基金 C 类份额,如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元,则其可得到的 C 类基金份额计算如下:

认购份额 =(10,000+5)/1.00 = 10,005 份

即投资者投资 10,000 元认购本基金的 C 类基金份额,加上认购资金在认购期内获得的利息,可得到 10,005 份 C 类基金份额。

十一、投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排、认购者认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

2、认购方式

本基金认购采取金额认购的方式。

(1)投资者认购前,需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

(2)基金投资者在募集期内可多次认购,认购一旦被注册登记机构确认,就不再接受撤销申请。

3、认购确认

基金发售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。投资者可在基金正式宣告成立后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。若投资者的认购申请被确认为无效,基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

4、认购限制

在募集期内,除《发售公告》另有规定,每一基金投资者通过本公司网上交易系统和销售机构销售网点每个基金账户首次认购的最低额为人民币 10 元(含认购费),追加认购最低金额为 10 元(含认购费);直销机构销售网点(非网上交易系统)每个基金账户认购的最低金额为人民币 50,000 元(含认购费)。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。已在基金管理人销售网点有认购本基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制,但受追加认购最低金额的限制。本基金募集期间对单个基金份额持有人不设置最高认购金额限制。

十二、首次募集期间认购资金利息的处理方式

本基金合同生效前,基金投资者的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资者认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

十三、基金募集期间募集的资金存入专用账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集金额不少于 1000 万元人民币的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。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。基金管理人应将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。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息;

3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《基金合同》生效后三年内,基金资产净值不低于 1000 万元人民币。

《基金合同》生效满三年后继续存续的,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元人民币情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时,从其规定。

四、基金的自动终止

本基金基金合同生效满三年之日,若基金资产净值低于 2 亿元人民币,基金合同自动终止。若届时的法律法规或证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或证监会规定执行。

第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。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。本基金的销售机构包括:

1、本公司直销机构;

2、代销机构:经本公司委托,具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。

本基金销售机构的具体名单,详见本基金招募说明书第五部分。

二、申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,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。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、"未知价"原则,即申购、赎回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内撤销;

4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

四、申购与赎回的数额限制

1、通过代销机构每个基金账户或基金管理人网上交易系统(目前仅对个人投资人开通)每个基金账户首次最低申购金额为 10 元人民币(含申购费);投资人追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构网点公告。各基金代理销售机构有不同规定的,投资者在该销售机构办理上述业务时,需同时遵循销售机构的相关业务规定。

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元(含申购费)人民币;已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受申购最低金额的限制。

3、基金份额持有人在各销售机构的最低赎回、转换转出及最低持有份额为 1 份,投资者当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足 1 份的,注册登记机构有权将全部剩余份额自动赎回。各基金代理销售机构有不同规定的,投资者在该销售机构办理上述业务时,需同时遵循销售机构的相关业务规定。

4、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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,具体规定请参见相关公告。

6、基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;本基金登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;本基金登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请生效后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日),在正常情况下,本基金登记机构在 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,投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定生效,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况,投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不生效,则申购款项退还给投资人。

六、申购费率、赎回费率

1、申购费率

(1)本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用,C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类份额对申购设置级差费率。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

A类份额申购金额(M)	A类份额申购费率
M<100 万元	1.2%
100万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	每笔 1,000 元

(2)本基金 A 类份额的申购费用由 A 类份额基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金 A 类份额的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(3)基金管理人对部分基金持有人费用的减免不构成对其他投资者的同等义务。

2、赎回费率

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额收取的赎回费级差和费率不同,赎回费计入基金财产的比例不同,具体如下:

(1)A 类基金份额赎回费率:

赎回期限(N)	赎回费率
1天≤N<7 天	1.50%
7天≤N<1 年	0.5%
1年≤N<2 年	0.3%
N≥2 年	0

其中,1 年指 365 天。

(2)C 类基金份额赎回费率:

赎回期限(N)	赎回费率
1天≤N<7 天	1.50%
7天≤N(30 天	0.5%
N≥30 天	0

其中:

A 类基金份额对持有期限少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持有期限长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费的 75%计入基金财产;对持有期限长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费的 50%计入基金财产;对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费的 25%计入基金财产。

C 类基金份额对投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、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、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依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告。

4、对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),在不违背法律法规规定的情况下,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、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、赎回费率和转换费率。

6、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、本基金申购份额的计算:

本基金采用"金额申购"方式,申购价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算。

(1)若投资者选择申购 A 类基金份额,申购份额的计算方法为:

净申购金额 = 申购金额 /(1+申购费率)

或,净申购金额 = 申购金额 – 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 – 净申购金额

或,申购费用 = 固定申购费金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例:某投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类份额,假设申购当日 A 类份额净值为 1.050 元,则可得到的申购份额为:

净申购金额 =10,000/(1+1.2%)=9,881.42 元

申购费用 =10,000–9,881.42=118.58 元

申购份额 =9,881.42/1.050=9410.88 份

即:投资者投资 10,000 元申购本基金 A 类份额,对应申购费率为 1.2%,假设申购当日 A 类份额净值为 1.050 元,则可得到 9410.88 份 A 类份额。

(2)若投资人选择申购 C 类基金份额,申购份额的计算方法为:

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

例:某投资人投资 10,000 元申购本基金 C 类份额,假设申购当日 C 类份额净值为 1.050 元,则可得到的申购份额为:

申购份额 =10,000/1.050=9523.81 份

即:投资者投资 10,000 元申购本基金 C 类份额,假设申购当日 C 类份额净值为 1.050 元,则可得到 9523.81 份 C 类份额。

2、本基金赎回金额的计算:

本基金采用"份额赎回"方式,赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算,计算公式:

赎回总金额 = 赎回份额 × T 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

例:某投资者赎回 10 万份 A 类基金份额,份额持有期限 100 天,对应赎回费率为 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.213 元,则:

其可得到的 A 类份额赎回金额为:

赎回总金额 =100,000 × 1.213 = 121,300.00 元

赎回费用 =121,300.00 × 0.5% = 606.50 元

净赎回金额 =121,300.00 – 606.50=120,693.50 元

即:投资者赎回本基金 10 万份 A 类基金份额,份额持有期限 100 天,对应赎回费率 0.5%,假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.213 元,则其可得到的净赎回金额为 120,693.50 元。

例:某投资者赎回 10 万份 C 类基金份额,份额持有期限 6 天,对应赎回费率为 1.5%,假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.100 元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总金额 =100,000 × 1.100 = 110,000.00 元

赎回费用 =110,000.00 × 1.5%=1650 元

净赎回金额 =110,000.00 – 1650=108,350.00 元

即:投资者赎回本基金 C 类基金份额 10 万份,份额持有期限 6 天,对应赎回费率 0.5%,假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元,则其可得到的净赎回金额为 109,450.00 元。

3、本基金基金份额净值的计算:

由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为:T 日某类基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值 /T 日该类别基金份额的余额数量。

本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,由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。

4、申购份额、余额的处理方式:

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

5、赎回金额的处理方式:

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后,正常情况下,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 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回基金成功后,正常情况下,基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

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,并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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、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、目标 ETF 暂停基金资产估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

7、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌,基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。

8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

9、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。

10、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、6、7、8、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时,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。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人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、目标 ETF 暂停基金资产估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

6、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或证券交易所场内交易停牌等有必要暂停本基金赎回的情形。

7、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

8、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,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时,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。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。

十一、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) 超过前一开放日的基金总份额的 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、部分延期赎回或暂停赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,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。

当发生巨额赎回时,对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 10%以上的场外赎回申请部分,将自动进行延期办理;对于其余赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日可确认的赎回份额;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 个开放日以上(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

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

十二、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,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

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、如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

十三、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,并提前告知基金托管人与相关机构。但本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间暂不允许进行相互转换。

十四、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。

十五、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。

十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十七、基金的冻结与解冻与质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

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

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金主要通过投资于目标 ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

二、投资范围

本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、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)。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产的 90%,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,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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本基金为 ETF 联接基金,主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内,年化跟踪误差控制在 4%以内。

(一)资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股,其中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产的 90%,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,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。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、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,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)目标 ETF 投资策略

1、投资组合的投资方式

本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或证券交易所场内交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整。

2、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标 ETF 的时间和方式。

(1)当净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等;

(2)当净赎回时,本基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定目标 ETF 的赎回或卖出等。

(三)股票投资策略

1、股票组合构建原则

根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法,根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当变通和调整,以更紧密的跟踪标的指数。

3、股票组合的调整

(1)定期调整

本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的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。

(四)债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。

(五)股指期货的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,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,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

(六)权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于提高基金资产的投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

(七)资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

四、业绩比较基准

本基金以中证传媒指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为:95% × 中证传媒指数收益率 +5% × 银行活期存款利率(税后)。

由于本基金为被动投资的指数基金,跟踪标的为中证传媒指数,因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果中证传媒指数被停止编制及发布,或中证传媒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中证传媒指数不宜继续作为本基金的标的指数,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

五、风险收益特征

本基金为 ETF 联接基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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。

六、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1、本基金持有的目标 ETF 的比例不得低于基金资产的 90%;

2、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,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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

3、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

4、本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

5、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

6、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

7、本基金参与股指期货交易,应当符合下列投资限制: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%;在任何交易日日终,持有的买入股指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;基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;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%;

8、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,不得超过基金资产净值的 10%;

9、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%;

10、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

11、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

12、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;

13、本基金在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%,债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

14、本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

15、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%,因证券市场波动、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款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

16、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;

17、法律法规及《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除第 2、3、11、15、16 条规定的情形外,因证券或期货市场波动、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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如法律法规或监管机构对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更或取消限制的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,本基金可根据法律法规规定,在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

七、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

1、承销证券;

2、违反规定向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

5、向其基金管理人、基金托管人出资;

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

7、法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理

目标 ETF 出现下述情形之一的,本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金;若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,选取其他合适的指数作为标的指数。相应地,基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分,或将变更标的指数,届时将由基金管理人另行公告。

1、目标 ETF 终止上市;

2、目标 ETF 基金合同终止。

若目标 ETF 变更标的指数,本基金将相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的,本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决,目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的,本基金可不召开基金份额持有人大会,相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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。

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

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。

四、基金财产的保管和处分

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。

第十一部分 基金资产的估值

一、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。

二、估值对象

基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、目标 ETF 份额的估值

本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值,若估值日为非证券交易所营业日,以该基金最近估值日的基金份额净值估值。

2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券(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或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、处于未上市期间的权益类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。

4、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(2)对在交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后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;

(3)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

5、银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,按成本估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。

7、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。

8、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

10、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。

11、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,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,各类基金资产净值除以当日该类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。

五、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。

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。

(下转 28 版)