上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

本基金于2014年9月9日经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】932号文准予注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于中风险/收益的开放式基金。本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证可质押城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

第一部分 绪言

《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称"招募说明书"或"本招募说明书"）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《公开募集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》"）以及《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"基金"或"本基金"）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

1、基金或本基金：指上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人：指海富通基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国银行股份有限公司

4、基金合同：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金"

15、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外机构投资者：指符合《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可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、特定机构投资者：指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》所定义机构投资者

23、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

24、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

25、销售机构：指直销机构和代销机构

26、直销机构：指海富通基金管理有限公司

27、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

28、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的、在募集期间代理本基金发售业务的机构

29、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的，在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

30、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

31、登记机构：指中国证券登记结算有限责任公司

32、业务规则：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定

33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

34、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

35、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过三个月

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

39、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

40、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为赎回对价的行为

45、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

46、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

47、赎回对价：指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

48、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

49、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的上证可质押城投债指数及其未来可能发生的变更

50、现金替代：指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

51、现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按基金合同约定的估值方法计算的最小申购、赎回单位中的组合证券价值和现金替代之差；投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

52、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

53、预估现金部分：指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结

54、基金份额折算：指基金管理人根据基金合同的规定将基金份额持有人的基金份额进行变更登记的行为

55、元：指人民币元

56、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

57、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

59、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

60、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

61、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

62、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：张文伟

成立时间：2003年4月18日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：1.5亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。

二、主要人员情况

张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

邵国有先生，董事，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理、海富通基金管理有限公司董事长。2013年5月起转任海富通基金管理有限公司董事。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。

陶乐斯（Ligia Torres）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎投资管理公司亚太区及新兴市场主管。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事总经理、Pionner投资公司（米兰，都柏林，卢森堡）独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

魏海诺（Bruno Weil）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，现任南京银行副行长。

奚万荣先生，监事，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司内部审计。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任稽核经理、监察稽核总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

高勇前先生，监事，经济学学士。历任宁波进出口公司财务部会计主管、上海科源医学高科技实业公司财务部财务主管、华安基金管理有限公司财务核算部副总监。2008年4月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司中后台运营总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2014年9月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事、总经理。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈轶平先生，博士，CFA。2009年1月至2009年8月任Mariner Investment Group LLC分析师，2009年10月至2011年9月任瑞银企业管理（上海）有限公司副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，任债券投资经理。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起任海富通季季增利理财债券基金经理。

本基金拟任基金经理陈轶平先生，简历如上。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；戴德舜，投资总监；邵佳民，总经理助理；丁俊，投资副总监；杜晓海，定量及风险管理总监，兼任上海富诚海富通资产管理有限公司投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1. 依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
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、赎回对价；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 按照规定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、基金管理人的承诺

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（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）用基金资产承销证券；
（6）违反规定用基金资产向他人贷款或提供担保；
（7）用基金资产从事承担无限责任的投资；
（8）用基金资产买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
（9）以基金资产向基金管理人、基金托管人出资；
（10）用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
（11）法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

3. 基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；
（2）违反基金合同或托管协议；
（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
（6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以提高自己；
（10）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
（11）以不正当手段谋求业务发展；
（12）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（13）法律法规禁止的其他行为。

4. 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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
（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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。
（4）不以任何形式为其他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

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

（1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；

（下转B18版）

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：	海富通基金管理有限公司
基金托管人：	中国银行股份有限公司
登记机构：	中国证券登记结算有限责任公司
基金销售机构：	销售机构为海富通基金管理有限公司的直销中心和销售机构（即符合《证券投资基金销售管理办法》和中国证监会规定的其它条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商）。 上市推荐人：海通证券股份有限公司 发售主协调人：海通证券股份有限公司 网下现金发售和网下债券发售直销机构：海富通基金管理有限公司 网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构： 海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司和申银万国证券股份有限公司。 网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、天源证券有限公司、财富里昂证券有限责任公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、万和证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、宏信证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、诚浩证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司、川财证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、湘财证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、华林证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、东兴证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、开源证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、中航证券有限公司、广发证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、中天证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信万通证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、国开证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司。

重要提示

1. 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"）的募集已获中国证监会证监许可【2014】932号文准予注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或保证。

2. 本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3. 本基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称"本公司"）；基金托管人为中国银行股份有限公司；登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4. 本基金自2014年10月17日起至2014年11月7日止通过销售机构公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购以及网下债券认购等三种方式认购本基金。其中，网下现金发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日，网上现金发售日期为2014年11月5日起至2014年11月7日，通过发售代理机构及基金管理人进行网下债券认购的发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日。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。

本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：

序号	证券公司名称	序号	证券公司名称	序号	证券公司名称
1	爱建证券有限责任公司	34	国信证券股份有限公司	67	首创证券有限责任公司
2	安信证券股份有限公司	35	国元证券股份有限公司	68	太平洋证券股份有限公司
3	渤海证券股份有限公司	36	海通证券股份有限公司	69	天风证券股份有限公司
4	财达证券有限责任公司	37	恒泰长财证券有限责任公司	70	天源证券有限公司
5	财富里昂证券有限责任公司	38	恒泰证券股份有限公司	71	万和证券有限责任公司
6	财富证券有限责任公司	39	宏信证券有限责任公司	72	万联证券有限责任公司
7	财通证券股份有限公司	40	宏源证券股份有限公司	73	西部证券股份有限公司
8	长城证券有限责任公司	41	红塔证券股份有限公司	74	西藏同信证券有限责任公司
9	长江证券股份有限公司	42	华安证券有限责任公司	75	西南证券股份有限公司
10	诚浩证券有限责任公司	43	华宝证券有限责任公司	76	厦门证券有限公司
11	川财证券有限责任公司	44	华创证券有限责任公司	77	湘财证券股份有限公司
12	大通证券股份有限公司	45	华福证券有限责任公司	78	新时代证券有限责任公司
13	大同证券经纪有限责任公司	46	华林证券有限责任公司	79	信达证券股份有限公司
14	德邦证券有限责任公司	47	华龙证券有限责任公司	80	兴业证券股份有限公司
15	第一创业证券股份有限公司	48	华融证券股份有限公司	81	银泰证券有限责任公司
16	东北证券股份有限公司	49	华泰联合证券有限责任公司	82	英大证券有限责任公司
17	东方证券股份有限公司	50	华泰证券股份有限公司	83	招商证券股份有限公司
18	东海证券股份有限公司	51	华西证券有限责任公司	84	浙商证券股份有限公司
19	东吴证券股份有限公司	52	华鑫证券有限责任公司	85	中国国际金融有限公司
20	东兴证券股份有限公司	53	江海证券有限公司	86	中国民族证券有限责任公司
21	东莞证券有限责任公司	54	金元证券股份有限公司	87	中国银河证券股份有限公司
22	方正证券股份有限公司	55	开源证券有限责任公司	88	中国中投证券有限责任公司
23	光大证券股份有限公司	56	联讯证券有限责任公司	89	中航证券有限公司
24	广发证券股份有限公司	57	民生证券股份有限公司	90	中山证券有限责任公司
25	广州证券有限责任公司	58	南京证券股份有限公司	91	中天证券有限责任公司
26	国都证券有限责任公司	59	平安证券有限责任公司	92	中信建投证券股份有限公司
27	国海证券股份有限公司	60	齐鲁证券有限公司	93	中信万通证券有限责任公司
28	国金证券股份有限公司	61	日信证券有限责任公司	94	中信证券（浙江）有限责任公司
29	国开证券有限责任公司	62	瑞银证券有限责任公司	95	中信证券股份有限公司
30	国联证券股份有限公司	63	山西证券股份有限公司	96	中银国际证券有限责任公司
31	国盛证券有限责任公司	64	上海证券有限责任公司	97	中邮证券有限责任公司
32	国泰君安证券股份有限公司	65	申银万国证券股份有限公司	98	中原证券股份有限公司
33	爱建证券有限责任公司	66	世纪证券有限责任公司		

5. 本基金管理人可办理网下现金发售和网下债券发售。

本基金的网下现金发售和网下债券发售的发售代理机构为：海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司和申银万国证券股份有限公司。

6. 投资者认购本基金时需持有上海证券交易所A股账户（以下简称"A股账户"）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称"上海证券交易所基金账户"）。

（1）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

①上海证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回，则应开立A股账户。

②投资者开立证券账户，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

③开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

（2）如投资者已开立证券账户，则应注意：

①如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（3）使用专用交易单元的机构投资人则无需办理指定交易。

7. 本基金认购费用或认购佣金不超过认购份额的0.4%。

8. 网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份），超过部分须为1万份的整数倍。投资者通过发售代理机构办理网下债券认购的，单只债券最低认购申报数为1手（人民币1000元面值债券为1手），超过1手的部分须为1手的整数倍；投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单只债券认购申报数必须为1手的整数倍，单笔认购份额须在50万份以上（含50万份）。上述认购方式投资者均可以多次认购，累计认购不设上限。

9. 网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购、网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

10. 销售网点（指基金管理人和/或销售机构的销售网点）对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以登记机构或基金管理人的确认登记为准。基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

11. 本公告仅对本基金基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读2014年10月14日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称"招募说明书"）。

12. 本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（www.hftfund.com），投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

13. 各发售代理机构的销售网点以及开户认购等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

14. 未开设销售网点的地方的投资者，可拨打本公司的客户服务电话40088-40099咨询基金认购事宜。

15. 由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，开放日的具体业务办理时间可能有所不同，投资者应参照各基金销售机构的具体规定。

16. 本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整。

17. 基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商（亦称"一级交易商"）名单，报上海证券交易所，经有关部门认可后，由上海证券交易所公告。本基金上市后，指定交易未在一级交易商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到本基金的一级交易商。

18. 风险提示

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。

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。本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金，采用分层抽样复制策略，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。

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。

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。本基金以1元初始面值开展基金募集，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。

投资者应当通过基金管理人或基金发售代理机构认购本基金，基金发售代理机构名单详见本基金招募说明书以及相关公告。

一、本次发售基本情况

1. 基金名称

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

场外简称：海富通上证可质押城投债ETF，

场内简称：城投ETF，

网上现金认购代码：511223，

二级市场交易代码：511220。

2. 基金类型

债券型证券投资基金

3. 基金运作方式

交易型开放式

4. 基金存续期限

不定期。

5. 基金份额初始面值

本基金的初始份额面值为人民币1.00元。

6. 投资目标

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

7. 投资范围和对象

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。

8. 发售对象

中华人民共和国境内的个人投资人、机构投资人及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者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

9. 销售机构

（1）上市推荐人

海通证券股份有限公司

（2）发售协调人

主协调人：

海通证券股份有限公司

（3）网下现金发售和网下债券发售直销机构

海富通基金管理有限公司

（4）网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构

海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司和申银万国证券股份有限公司。

（5）网上现金发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：

序号	证券公司名称	序号	证券公司名称	序号	证券公司名称
1	爱建证券有限责任公司	34	国信证券股份有限公司	67	首创证券有限责任公司
2	安信证券股份有限公司	35	国元证券股份有限公司	68	太平洋证券股份有限公司
3	渤海证券股份有限公司	36	海通证券股份有限公司	69	天风证券股份有限公司
4	财达证券有限责任公司	37	恒泰长财证券有限责任公司	70	天源证券有限公司
5	财富里昂证券有限责任公司	38	恒泰证券股份有限公司	71	万和证券有限责任公司
6	财富证券有限责任公司	39	宏信证券有限责任公司	72	万联证券有限责任公司
7	财通证券股份有限公司	40	宏源证券股份有限公司	73	西部证券股份有限公司
8	长城证券有限责任公司	41	红塔证券股份有限公司	74	西藏同信证券有限责任公司
9	长江证券股份有限公司	42	华安证券有限责任公司	75	西南证券股份有限公司
10	诚浩证券有限责任公司	43	华宝证券有限责任公司	76	厦门证券有限公司
11	川财证券有限责任公司	44	华创证券有限责任公司	77	湘财证券股份有限公司
12	大通证券股份有限公司	45	华福证券有限责任公司	78	新时代证券有限责任公司
13	大同证券经纪有限责任公司	46	华林证券有限责任公司	79	信达证券股份有限公司
14	德邦证券有限责任公司	47	华龙证券有限责任公司	80	兴业证券股份有限公司
15	第一创业证券股份有限公司	48	华融证券股份有限公司	81	银泰证券有限责任公司
16	东北证券股份有限公司	49	华泰联合证券有限责任公司	82	英大证券有限责任公司
17	东方证券股份有限公司	50	华泰证券股份有限公司	83	招商证券股份有限公司
18	东海证券股份有限公司	51	华西证券有限责任公司	84	浙商证券股份有限公司
19	东吴证券股份有限公司	52	华鑫证券有限责任公司	85	中国国际金融有限公司
20	东兴证券股份有限公司	53	江海证券有限公司	86	中国民族证券有限责任公司
21	东莞证券有限责任公司	54	金元证券股份有限公司	87	中国银河证券股份有限公司
22	方正证券股份有限公司	55	开源证券有限责任公司	88	中国中投证券有限责任公司
23	光大证券股份有限公司	56	联讯证券有限责任公司	89	中航证券有限公司
24	广发证券股份有限公司	57	民生证券股份有限公司	90	中山证券有限责任公司
25	广州证券有限责任公司	58	南京证券股份有限公司	91	中天证券有限责任公司
26	国都证券有限责任公司	59	平安证券有限责任公司	92	中信建投证券股份有限公司
27	国海证券股份有限公司	60	齐鲁证券有限公司	93	中信万通证券有限责任公司
28	国金证券股份有限公司	61	日信证券有限责任公司	94	中信证券（浙江）有限责任公司
29	国开证券有限责任公司	62	瑞银证券有限责任公司	95	中信证券股份有限公司
30	国联证券股份有限公司	63	山西证券股份有限公司	96	中银国际证券有限责任公司
31	国盛证券有限责任公司	64	上海证券有限责任公司	97	中邮证券有限责任公司
32	国泰君安证券股份有限公司	65	申银万国证券股份有限公司	98	中原证券股份有限公司
33	爱建证券有限责任公司	66	世纪证券有限责任公司		

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

10. 发售时间安排与基金合同生效

根据有关法律法规的规定，基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集期自2014年10月17日起至2014年11月7日，期间面向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售。其中，网下现金发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日，网上现金发售日期为2014年11月5日起至2014年11月7日，通过发售代理机构及基金管理人进行网下债券认购的发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日。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。募集结束，若符合基金合同规定的生效条件，基金管理人将办理基金备案手续，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。

若3个月的法定募集期满，本基金的基金合同仍未达到基金合同规定的生效条件，本基金管理人将以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将所募集的资金加计募集期间投资者通过现金认购方式购买本基金所产生的同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还给基金认购人。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，登记机构应予以解冻。

11. 基金认购方式与费率

（1）认购价格：本基金份额的认购价格为1.00元/份。

（2）认购费用：

认购费用由投资人承担，不高于0.4%，认购费率如下表所示：

图表1：认购费率

认购份额	认购费率
50万份以下	0.40%
50万份以上（含），100万份以下	0.20%
100万份以上（含）	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

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、登记等募集期间发生的各项费用。

（3）网上现金认购

1. 认购时间2014年11月5日起至2014年11月7日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。

2.认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3.认购金额的计算

本基金认购金额的计算如下：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者到某发售代理机构网点认购10,000份本基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.4%，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金=10,000×1.00×0.4%=40元

认购金额=10,000×1.00×（1+0.4%）=10,040元

即投资者需准备10,040元资金，方可认购到10,000份本基金基金份额。

（下转B20版）

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同的内容摘要

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，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、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换的业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，编制申购赎回清单；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、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、足额支付赎回对价；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

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

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《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）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（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、赎回对价的现金部分；
（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、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）按照法律法规、基金合同规定的年限保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
（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对价的现金部分；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法申请转让或赎回其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
（4）缴纳基金认购款项和认购债券、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）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）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）本基金与其他基金的合并；
（7）变更基金投资目标、范围或策略；
（8）变更基金份额持有人大会程序；
（9）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
（10）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；
（11）终止基金上市，但被上海证券交易所决定终止上市的除外；
（12）转换基金运作方式；
（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
（4）因相应的法律法规、证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
（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重大变化；
（6）调整本基金份额类别设置；
（7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、单独或合计持有本基金总份额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，单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

5、单独或合计持有本基金总份额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，单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

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》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（下转B20版）