

# MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书

## （上接B71版）

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人其持有的基金份额低于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开前的三个月内,每个月内,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1/3以上 或1/3 基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。

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意见以书面形式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少于权益登记日基金总份额的12 或12 。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人持有的基金份额低于上述规定比例的,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1/3以上 或1/3 基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。

4) 上述第 6 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。

6) 会议通知中载明会议时间、地点、会议名称。

3.在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 15.议事程序及授权

15.1 议事程序及授权  
议事程序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、基金合同和证监会另有规定的除外)、法律法规 基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需经基金份额持有人大会决议的其他事项。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) 通讯开会

在现场开会的前提下,首先由大会主持人按照下列第七节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未能主持会,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 或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临时召集人。基金管理人和基金托管人拒不授权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) 现场开会

在通讯开会的前提下,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5个工作日内在公证机关监督下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的表决方式为一般记名投票和通讯表决。

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 或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2/3以上 或2/3 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 基金合同及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条件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具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

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。

3) 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(确由基金托管人授权)的监督下,根据会议通知的约定对书面表决意见进行计票,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绝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。

## 8. 生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自决议通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自生效后方可执行,并须按照法律法规和中国证监会相关规定的要求在指定媒介上公告。

基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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自公告之日起5个工作日内生效,基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金份额持有人大会的决议自公告之日起5个工作日内生效。

9.关于本基金目标ETF联接基金,本基金基金份额持有人可以凭所持有的本基金认购份额与目标ETF相关的持有人权利,如目标ETF持有大会召集人授权,基金份额持有人大会的决议,计算基金份额和计票时,本基金基金份额持有人的参会份额按股票权益登记日本基金持有的目标ETF的基金份额,该持有人所持有的本基金份额对应的本基金总份额的10%。本基金持有人,如经基金管理人确认其单独或合计持有的联接基金份额对应的目标ETF份额不少于目标ETF份额的10%的,可对目标ETF行使基金份额持有人大会的表决权。

如目标ETF召开基金份额持有人大会,本基金的基金份额持有人有权亲自出席出具书面表决意见或以代理投票方式书面委托代表出席出具书面表决意见,并有权按照所持有的本基金基金份额对应的目标ETF份额参与投票表决。

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

10. 法律法规或监管机构对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

## 第三部分 基金的投资与分配

一、基金收益分配原则

1.每一基金份额持有人享有同等分配权;

2.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%;若 基金合同生效不满3个月不进行收益分配;

3.本基金基金收益分配方式分为两种:现金分红和红利再投资,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;若投资者选择不选择,本基金默认的收益分配方式为现金分红;

4.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

5.法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

在遵守法律法规的前提下,基金管理人、登记机构和可对基金收益分配的有关业务规则进行调整,并及时公告。

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

三、收益分配方案的实施、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,在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

四、基金收益分配中发生费用的处理  
基金收益分配中发生的所有银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额,红利再投资的费用,依照《业务规则》执行。

## 第四部分 基金的费用

一、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.标的指数许可使用费;

4.基金上市费及年费(如有);

5. 基金合同生效后的与基金相关的信息披露费用;

6. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所和诉讼费;

7. 基金份额持有人大会费用;

8. 基金投资目标ETF的相关费用(包括但不限于目标ETF的交易费用、申购赎回费用等);

9. 基金的证券交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证券管理费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等);

10. 基金的银行汇划费用;

11. 基金收益分配中发生的费用;

12. 按照法律法规及基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会允许的前提下,本基金可以在基金财产中计提销售服务费,不需召开持有人大会,具体计提方法、计提标准和费用支付方式

1. 基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.50%年费率计提,管理费的计算方法如下:

$H=E \times 0.50\%$  当年天数  
H为每日应计提的管理费  
E为前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分,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前2-5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、公休日等,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费  
本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.10%的年费率计提,托管费的计算方法如下:

$H=E \times 0.10\%$  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资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分,若为负数,则E取0。

基金管理费、基金托管费、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前2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3. 标的指数许可使用费  
本基金按照基金管理人与指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费,指数许可使用费的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。

如果指数许可方许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第4-11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。

3. 不列入基金费用的项目  
下列费用不列入基金费用:  
1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3. 基金合同生效前的相关费用;

4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不列入基金费用的项目。

## 第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资目标  
通过对目标ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。

### 2. 投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额,标的指数的成份股,备选成份股,为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非国债、债券、中小企业私募债券、股指期货、权证、国债期货、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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内。

### 3. 投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF,根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将参与目标ETF的申购、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数的非跟踪标的指数,为了更好地实现投资目标,基金还可投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生品,如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具,基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。基金还可适度参与与目标ETF基金股指期货交易和申购、赎回及股指期货之间的投资操作,以及目标ETF的合并分析,以增强基金收益。

此外,本基金还将积极参与与风险低且可控的债券回购等投资,以及国债期货投资,基金投资国债期货将本着谨慎的原则,充分考量其流动性和风险收益特征,适度参与国债期货投资。

本基金可以基金资产参与目标ETF的申购、赎回,以及参与基金建仓。

本基金参与单只国债期货偏离度的绝对值不超过35%,年跟踪误差率不超过4%。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

## 4. 投资限制

### 1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

0) 本基金管理人管理的、其市值不得超过基金资产净值的3%;

1) 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%;

2) 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%;

3) 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%;

4) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

5) 本基金持有的同一一级信用级别 资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

6) 本基金投资于同一原始信用级别为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;

7) 基金资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;

8) 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%;在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期。

9) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;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%;在任何交易日内存 包平仓 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%;基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)不得超过基金合同下股票投资比例的有关约定;

10) 基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的20%;基金在任何交易日内存 包平仓 的国债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30%;基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

11) 基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;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%;在任何交易日内存 包平仓 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%;基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

12) 基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;基金在任何交易日内存 包平仓 的国债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30%;基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

13) 本基金总资产不得超过基金资产净值的100%;

14) 本基金管理人管理的、其市值不得超过基金资产净值的10%;

15) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

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申购、赎回、交易被暂停或交易延迟、股权结构改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在下一个交易日内进行调整,法律法规另有规定的,从其规定。

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。期间,基金的投资范围、投资策略应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。

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

## 2. 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提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 向其他基金管理人、基金托管人出资;
- 5) 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;
- 6) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

## 第六部分 基金资产净值的计算和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

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

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

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

## 第七部分 基金合同的终止与基金财产的清

一、基金合同的终止事由  
有下列情形之一的,基金合同应当终止:

- 1) 基金份额持有人大会决定终止;
- 2) 基金管理人、基金托管人职责终止,在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) 基金合同终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- 3) 对基金财产进行估值和变现;

## 5. 基金财产清算的公告

清算小组自成立后的第一个工作日,聘请会计师事务所进行外部审计,聘请律师事务所出具法律意见书。

6) 清算审计报告报中国证监会备案并公告。

## 7. 对基金资产进行分配

## 8. 基金财产清算的期限为6个月。

## 第八部分 争议的处

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

## 基金合同与中国法律法规

基金合同可印制或前,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

基金合同可印制或前,