

# 上证国有企100交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2015年第2号)

**基金管理人：** 中银基金管理有限公司  
**基金托管人：** 招商银行股份有限公司  
**二〇一五年七月**

## 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年2月23日证监许可【2011】269号文核准，基金合同于2011年6月16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券监督管理委员会(以下简称“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、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。

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,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券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、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金资产管理过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金为股票基金,其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金在股票基金中属于指数基金,紧密跟踪标的指数,是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日2015年6月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人招商银行已复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金合同生效日期

2011年6月16日

## 二、基金管理人

### (一)基金管理人概况

名称:中银基金管理有限公司  
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼  
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼  
 法定代表人:谭炯  
 设立日期:2004年8月12日  
 电话:(021)38834999  
 传真:(021)68872488  
 联系人:高爽秋  
 注册资本:1亿元人民币  
 股权结构:

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8360万元	83.3%
贝莱投资管理有限公司(英国)有限公司	相当于人民币1660万元的美元	16.6%

### (二)主要人员情况

#### 1. 董事会成员

白志中(BAI Zhizhong)先生,董事长。上海交通大学工商管理专业硕士,高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任,中国银行宁夏回族自治区分行行长、党委书记,中国银行广西壮族自治区分行行长、党委书记,中国银行四川省分行行长、党委书记,中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。

李道滨(LI Daobin)先生,董事。清华大学法学博士。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司,历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。现任中银基金管理有限公司执行总裁。

赵春堂(ZHAO Chuntang)先生,董事。南开大学世界经济专业硕士。历任中国银行国际金融研究所干部,中国银行董事会秘书部副处长、主管,中国银行上海市办公室主任,中国银行江西省分行行长助理、副行长、党委委员,中国银行个人金融总部副总经理等职。现任中国银行财富管理与私人银行部副总经理(主持工作)。

宋福宁(SONG Funing)先生,董事。厦门大学经济学硕士,经济师。历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副处长、资金业务部负责人、资金业务部总经理,中国银行总行金融市场部助理总经理,中国银行总行投资银行与资产管理部助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部副总经理。

葛伟炜(David Graham)先生,董事。葛伟炜先生于1977年—1984年供职于Deloitte Haskins Se&Is(现为普华永道)伦敦和悉尼分公司,之后,在拉扎比(Lazards)银行伦敦、香港和东京分公司任职。1992年,加入美林投资管理有限公司(MLIM),曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部门的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后,加入贝莱德。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理,主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。

朱善利(ZHU Shanli)先生,独立董事。北京大学经济学博士。曾任北京大学光华管理学院经济管理系讲师、副教授、主任、北京大学光华管理学院应用经济学系主任、北京大学光华管理学院副院长等职。现任北京大学光华管理学院教授、博士生导师,中国会计学会理事、全国会计专业学位教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事、安泰科技股份有限公司独立董事、风神轮胎股份有限公司独立董事。

赵欣柯(ZHAO Xinge)先生,独立董事。美国西北大学会计学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教,并曾为美国投资公司协会(美国共同基金行业协会)等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授和金融MBA主任,并在中国的数家上市公司和金融投资公司担任独立董事。

雷晓波(Edward Radcliffe)先生,独立董事。法国INSEAD工商管理硕士。曾任白狐技术有限公司总经理,目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前,曾任英国电信集团零售部门经理,贝特伯恩顾问公司董事、北京代表处首席代表、总经理、中英商会财务司库、英中贸易协会理事会成员。现任银珠合伙人有限公司合伙人。

#### 2. 监事

赵悦玲(ZHAO Huiping)先生,监事。国籍:中国。中央党校经济管理专业本科,人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、中国银

行人力资源部综合处副处长、处长、人事部技术干部处干部、副处长。

乐妮(YUE Ni)女士,职工监事。国籍:中国。上海交通大学工商管理硕士。曾分别就职于上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理公司。2006年7月加入中银基金管理有限公司,现任基金运营部总经理。具有14年证券从业年限,11年基金行业从业经验。

#### 3. 管理层成员

李道滨(LI Daobin)先生,董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军(Jason X. OUYANG)先生,督察长。国籍:加拿大。中国证券业协会—沃顿商学院高级管理培训班(Wharton-SAC Executive Program)毕业证书,加拿大西部大学毅伟商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士(MBA)和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年,也曾任蔚深证券有限责任公司(现光大证券)研究发展中心总经理、融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文(ZHANG Jiawen)先生,副执行总裁。国籍:中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

#### 4. 基金经理

赵建忠(ZHAO Jianzhong)先生:金融学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司,曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015年6月至今任中银中证100指数基金基金经理,2015年6月至今任国企ETF基金基金经理,2015年6月至今任中银沪深300等权重指数基金(LOF)基金经理。具有8年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

#### 曾任基金经理:

周小丹(ZHOU Xiaodan)先生,2011年6月至2015年6月担任本基金基金经理。  
 5. 投资决策委员会成员的姓名及职务  
 主席:李道滨(执行总裁)  
 成员:陈军(助理执行总裁)、杨军(资深投资经理)、奚鹏洲(固定收益投资部总经理)、李建(固定收益投资部副总经理)  
 列席成员:欧阳向军(督察长)

#### 6. 上述人员之间均不存在近亲属关系

#### 三、基金托管人

基金托管人基本情况  
 名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)

设立日期:1987年4月8日  
 注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
 办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
 注册资本:252.20亿元  
 法定代表人:李建红  
 行长:田惠宇  
 资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号  
 电话:0755—83199084  
 传真:0755—83195201  
 资产托管部信息披露负责人:张燕  
 四、相关服务机构

#### (一)基金份额发售机构

1.申购赎回代理券商(简称“一级交易商”)  
 1)国泰君安证券股份有限公司  
 注册地址:上海市浦东新区商城路618号  
 办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼  
 法定代表人:万建华  
 联系人:芮敏祺  
 客服电话:95521  
 公司网站:www.gtja.com  
 2)华宝证券有限责任公司  
 注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
 办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
 法定代表人:陈林  
 联系人:汪明丽  
 客服电话:400-820-9898  
 公司网站:www.cnhbstock.com  
 3)中国银河证券股份有限公司  
 办公地址: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:陈有安  
 联系人:宋翔  
 客服电话:4008-888-888  
 公司网站:www.chinastock.com.cn  
 4)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号国信证券大厦十六层至二十六层  
 法定代表人:何如  
 联系人:周杨  
 客服电话:95536  
 公司网站:http://www.guosen.com.cn  
 2.二级市场交易代理券商  
 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。

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销售本基金,并及时公告。  
 (二)注册登记机构  
 名称:中国证券登记结算有限责任公司  
 注册地址:北京市西城区太平桥大街17号  
 办公地址:北京市西城区太平桥大街17号  
 法定代表人:周明  
 电话:(010)593778835  
 传真:(010)593778907  
 联系人:任瑞新  
 (三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师  
 名称:上海市通力律师事务所  
 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
 负责人:韩炯  
 电话:021-31358666  
 传真:021-31358600  
 联系人:秦悦民  
 经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师  
 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
 执行事务合伙人:吴港平  
 电话:010-58153000  
 传真:010-58188298  
 联系人:汤骏  
 经办会计师:徐艳、许培菁

#### 五、基金名称

上证国有企100交易型开放式指数证券投资基金

#### 六、基金的类型

基金类型:股票型

基金运作方式:交易型开放式指数基金

#### 七、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 八、基金的投资策略

本基金采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照上证国有企100指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。当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,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整,以使实现对跟踪误差的有效控制。本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

建仓期结束后,在正常市场情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.1%之内,年化跟踪误差控制在2%之内。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,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### 1. 决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

#### 2. 管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策,以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整及基金每日申购赎回清单的编制等决策。

#### 3. 管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合,构成了本基金的投资管理程序。  
 (1)研究。基金管理人依托其自身的研究平台,整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果,开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等研究性工作,作为本基金投资决策的重要依据。  
 (2)投资决策。基金管理人定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会会议,对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策。  
 (3)组合构建。基金经理采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,跟踪标的指数。

(4)交易执行。基金管理人的中央交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。  
 (5)投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估,并撰写相关的绩效评估报告,确认本基金是否实现了投资预期,投资策略是否成功,并对基金组合跟踪误差进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略,如果需要,亦对投资组合进行相应的调整。  
 (6)组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况,结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况,以及基金投资绩效评估结果等,对基金投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。  
 九、基金的业绩比较基准  
 本基金的业绩比较基准为:上证国有企100指数。  
 如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述标的指数由其它指数代替,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,履行适当程序后变更本基金的标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。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。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金,预期风险和收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证国有企100指数,是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。

#### 十一、投资组合报告

本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。  
 本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年6月23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。  
 本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。  
 (一)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	54,793,996.63	98.30
2	其中:股票	54,793,996.63	98.30
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	939,851.29	1.69
11	其他各项资产	7,141.12	0.01
12	合计	55,730,988.93	100.00

#### (二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的股票投资组合  
 本基金本报告期末未持有积极投资股票。  
 2、指数投资按行业分类的股票投资组合

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例

#### 大小排序的股票投资明细

1、期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例

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	600036	招商银行	194,982	3,032,946.64	5.47
2	600030	中信证券	92,314	3,029,746.48	5.46
3	601166	兴业银行	138,414	2,541,281.04	4.58
4	600037	海通证券	96,625	2,238,581.25	4.03
5	600000	浦发银行	135,913	2,146,066.27	3.87
6	601398	工商银行	351,200	1,706,832.00	3.08
7	601288	农业银行	396,400	1,464,788.00	2.62
8	601668	中国建筑	177,200	1,369,128.00	2.46
9	601601	中国太保	37,453	1,289,696.70	2.29
10	601026	交通银行	185,268	1,155,977.54	2.13

2、期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例

大小排序的前五名股票投资明细  
 本基金本报告期末未持有积极投资股票。  
 (四)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。  
 (五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细  
 本基金本报告期末未持有债券。  
 (六)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。  
 (七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
 本基金本报告期末未持有贵金属投资。  
 (八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
 本基金本报告期末未持有权证。  
 (九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策  
 本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策  
 本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价  
 本基金投资范围未参与国债期货投资,无相关投资评价。

(十一)投资组合报告附注  
 1、2014年07月24日,农业银行(601288)公告于2014年1月发布了《中国农业银行股份有限公司公告》(编号:临2013-034号),其中涉及香港会计师公会纪律委员会关于本行独立非执行董事胡定旭先生未遵守、维持或以其他方式应用公会的独立性要求的裁决。根据公会日期为2014年7月23日的新闻稿,委员会命令从专业会计师注册记录册除名胡定旭先生的名字,为期两年,且胡定旭先生须向公会缴付罚款25万港元。本基金管理人通过对该上市公司进行了进一步了解分析,认为该处分不直接针对上市公司主营业务,不会对其投资价值构成实质性影响,因此未披露处罚事宜。

2015年1月16日,证监会通报了去年四季度对45家券商进行的融资类业务现场检查的结果,宣布中信证券存在违规为到期融资融券合约展期问题,受过处理仍未改正,且涉及客户数量较多,对其采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施,中信证券表示将认真整改,全面梳理现有业务流程和规章制度,严格按照现有业务规则开展业务;  
 2015年1月16日,证监会通报了去年四季度对45家券商进行的融资类业务现场检查的结果,宣布海通证券存在违规为到期融资融券合约展期问题,受过处理仍未改正,且涉及客户数量较多,对其采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施;  
 本基金在报告期内持有中信证券股票、海通证券股票,基金管理人通过对该发行人进一步了解分析,认为公司所涉及的处分不会对上市公司投资价值构成实质性影响,因此未披露处罚事宜。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
 2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票范围。  
 3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,222.00
2	应收证券清算款	6,204,040
3	应收股利	-
4	应收利息	203,62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,141.12

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。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明  
 本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

(2)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明  
 本基金本报告期末未持有积极投资股票。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分  
 由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 十二、基金的费用

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
 本基金合同生效日为2011年6月16日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年6月16日(基金合同生效日)至2011年12月31日	-20.07%	1.24%	-19.30%	1.34%	-0.68%	-0.10%
2012年12月31日	11.60%	1.22%	10.23%	1.24%	1.46%	-0.01%
2013年1月1日至2013年12月31日	-13.32%	1.43%	-15.01%	1.44%	1.69%	-0.01%
2014年1月1日至2014年12月31日	67.87%	1.20%	65.88%	1.31%	1.99%	-0.02%
2015年1月1日至2015年3月31日	8.81%	2.05%	9.34%	2.07%	-0.33%	-0.02%
自基金合同生效以来截至2015年6月30日	41.31%	1.37%	36.72%	1.39%	4.59%	-0.02%

#### 十三、基金费用概览

(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)标的指数许可使用费;  
 4)基金财产划拨支付的银行费用;  
 5)基金上市费及年费;  
 6)基金收益分配中发生的费用;

7)基金合同生效后的基金信息披露费用;  
 8)基金份额持有人大会费用;  
 9)基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费;  
 10)基金的证券交易费用;  
 11)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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式  
 1)基金管理人的管理费  
 在通常情况下,基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下:  

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

$$H$$
为每日应计提的基金管理费  

$$E$$
为前一日基金资产净值  
 基金管理费每日计提,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。  
 2)基金托管人的托管费  
 在通常情况下,基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:  

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

$$H$$
为每日应计提的基金托管费  

$$E$$
为前一日基金资产净值  
 基金托管费每日计提,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3)标的指数许可使用费  
 本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数使用费每日计算,逐日累计。  
 计算方法如下:  

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

$$H$$
为每日计提的指数使用费, $E$ 为前一日的基金资产净值  
 自基金合同生效之日起,基金标的指数许可使用费每日计提,按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币50,000元,当季标的指数许可使用费不足50,000元,按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给指数供应商,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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。  
 本基金终止清算时所发生的费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。  
 3.不列入基金费用的项目  
 基金管理人及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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所