

# 景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 号更新招募

## 说明书 重要提示

(一) 景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)由基金管理人依照《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》)、《景顺长城沪深 300 等权重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”)及其他有关规定募集,并经中国证监会 2012 年 11 月 19 日证监许可【2012】1542 号文核准募集,本基金合同于 2013 年 5 月 7 日生效。

(二) 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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(四) 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。

(五) 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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(六) 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。本基金为交易型开放式指数证券投资基金(ETF),在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所,本基金的申购、赎回流程采用组合证券“场外实物申购、赎回”的模式办理,其申购、赎回流程与仅在深圳或上海交易所上市的非跨市场ETF产品有所差异。通常情况下,投资人的申购、赎回申请在 T+1 日确认,申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用。如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回,则应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户,且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有,同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管券商公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。

(七) 投资人在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,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,对认购和/或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规风险、本基金的特有风险和其他风险等。本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金,被动跟踪标的指数的表现,只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。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。

(八) 本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 11 月 7 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日。本更新招募说明书中财务数据未经审计。

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行股份有限公司

二、释 义 .....	2
三、基金管理人 .....	8

四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	28
六、基金的募集 .....	32
七、基金合同的生效 .....	42
八、基金份额折算与变更登记 .....	44
九、基金份额的上市交易 .....	45
十、基金份额的申购、赎回和非交易过户 .....	47
十一、基金的投资 .....	63
十二、基金的融资融券 .....	75
十三、基金的业绩 .....	76
十四、基金的财产 .....	78
十五、基金资产的估值 .....	79
十六、基金的收益分配 .....	86
十七、基金的费用与税收 .....	88
十八、基金的会计与审计 .....	92
十九、基金的信息披露 .....	93
二十、风险揭示 .....	99
二十一、基金的业务规则 .....	104
二十二、基金合同的变更、终止与清算 .....	105
二十三、基金合同的内容摘要 .....	108
二十四、基金托管协议的内容摘要 .....	126
二十五、对基金份额持有人的服务 .....	146
二十六、其他应披露事项 .....	148
二十七、招募说明书的存放及查阅方式 .....	149
二十八、备查文件 .....	150

## 一、绪言

本基金由景顺长城基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其它有关规定募集。

景顺长城沪深 300 等权重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”）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》以及基金合同等编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、投资策略、风险、费率、管理等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应当仔细阅读本招募说明书。

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”）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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指景顺长城基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对该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《景顺长城沪深 300

等权重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《景顺长城沪深 300 等权重交易型开 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《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数 证券投资基金基金份额发售公告》

8、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

9、《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，自 2004 年 6 月 1 日起实施，经 2012 年 12 月 28 日第 一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订并于 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做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、并于 2013 年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日公布、并于 2004 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

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日公布、并于 2014 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

13、《登记结算业务实施细则》：指《中国证券登记结算有限责任公司关于 深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订

14、交易型基金：指《登记结算业务实施细则》定义的“交易型基金”

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，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开 放式运 作方式的基金

16、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、 澳门特别行政区和台湾地区

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

19、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

20、个人投资者：指依据有关法律法規规定可投资于证券投资基金的自然人

21、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

22、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》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

23、人民币合格境外机构投资者：指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）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

24、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者、人民币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

25、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资人

26、基金份额持有人大会：指按照基金合同之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议

27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转托管等业务

28、销售机构：指直销机构和代销机构

29、直销机构：指景顺长城基金管理有限公司

30、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商（代办证券公司）

31、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代理本基金发售业务的机构

32、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

33、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

34、登记结算业务：指《登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算及相关业务

35、登记结算机构：指办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受中国证券登记结算有限责任公司委托代为办理登记结算业务的机构

36、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

37、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

38、基金募集期限：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 3 个月

39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

41、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人认购、申购、赎回或其他业务申请的开放日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

43、收益评价日：指基金管理人计算本基金净值增长率与标的指数增长率差额之日

44、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

45、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

46、认购：指在基金募集期内，投资人按基金合同的规定申请购买基金份额的行为

47、申购：指在基金合同生效后的存续期间，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为

48、赎回：指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人根据基金合同

和招募说明书的规定申请将其持有的本基金基金份额兑换为基金合同约定 的对价资产的行为

49、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

50、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

51、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，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

52、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 等权重指数及 其未来可能发生的变更

53、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

54、完全复制法：指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的 指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买 的比例，以达到复制指数的目的

55、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 人申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

56、现金替代：指申购或赎回过程中，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

57、现金替代退补款：指投资人支付的现金替代与基金购入被替代成份证 券的成本及相关费用的差额。若现金替代大于本基金购入被替代成份证券的成 本及相关费用，则本基金需向投资人退还差额，若现金替代小于本基金购入被 替代成份证券的成本及相关费用，则投资人需向本基金补缴差额

58、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最 小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购或赎回时应支 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

59、预估现金差额：指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布 的当日现金差额预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结

60、基金份额参考净值：指基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限 公

司根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由深圳 证券交易所所在交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

61、指令：指基金管理人在管理基金资产时，向基金托管人发出的资金划 拨及实物券调拨等指令

62、元：指人民币元

63、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

64、基金净值增长率：指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金 份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折 算日为初始日重新计算）

65、标的指数同期增长率：指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一 日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基 金份额折算日为初始日重新计算）

66、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收款 项及其他资产的价值总和

67、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

68、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所得 的单位基金份额的价值

69、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

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

71、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

### 三、基金管理人

（一）基金管理人概况 名称：景顺长  
城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层



设立日期：2003 年 6 月 12 日

法定代表人：杨光裕

注册资本：1.3 亿元人民币

批准设立文号：证监基金字[2003] 76 号

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

电话：0755-82370388

客户服务电话:400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨晦阳

股东名称及出资比例：

序号	股东名称	出资比例
1	长城证券股份有限公司	49%
2	景顺资产管理有限公司	49%
3	开滦（集团）有限责任公司	1%
4	大连实德集团有限公司	1%
合计		100%

## (二) 主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

杨光裕先生，董事长，工商管理硕士。曾担任江西财经大学教师，江西省审计厅办公室主任，海南汇通国际信托投资公司总会计师，长城证券股份有限公司副总裁，长城基金管理有限公司董事长，兼任长城嘉信资产管理有限公司董事长。2016 年 7 月加入本公司，任职公司董事长。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House 亚洲分公司的董事总经理。1992 至 1996 年间出任香港投资基金公会管理委员会成员，并于 1996 至 1997 年间担任公会主席。1997 至 2000 年间，担任香港联交所委员会成员，并在 1997 至 2001 年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

黄海洲先生，董事，工商管理硕士。1992 年 9 月起，历任招商银行股份有限公司深圳蛇口支行会计、工程管理部员工、人力资源部干部，新江南投资公司

副总经理。2005 年 5 月起担任长城证券副总经理，现任长城证券副总经理、党委委员。

许义明先生，董事，总经理，金融工程学硕士。曾先后就职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部，汇丰银行中国区财资部；也曾担任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理、香港景顺资产管理有限公司大中华区业务拓展总监等职务。2009 年 3 月加入本公司，任职公司董事兼总经理。

伍同明先生，独立董事，文学学士（1972 年毕业）。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977 受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师行”[KPMG]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打律师行、英国律师行 Clyde & Co. 从事律师工作，1993 年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

李晓西先生，独立董事。曾任国务院研究室宏观经济研究司司长。现任北京师范大学学术委员会副主任，教授、博士生导师；中国社会科学院研究生院教授、博士生导师；教育部社会科学委员会经济学部召集人。

## 2、基金管理人监事会成员

李翔先生，监事，高级管理工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

郭慧娜女士，监事，管理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

赵春来先生，监事，经济学硕士。曾担任阳光基金公司研究部研究员；先后任职于国信证券基金债券部、投资管理部、投资研究部、风险监管部、投资管理

总部等部门，从事宏观经济、股票债券研究、行业公司研究，投资业务风险监管，自营投资交易、管理等工作；也曾担任交银施罗德基金交易部交易主管。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

杨光裕先生，董事长，简历同上。

许义明先生，总经理，简历同上。

周伟达先生，副总经理，工商管理硕士。曾担任联博香港有限公司分析员、中国研究总监兼上海代表处首席代表、亚洲（除日本外）增长型股票投资负责人、高级副总裁，友邦保险有限公司上海分公司资产管理中心副总裁。2014年4月加入本公司，任职公司副总经理。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾先后任职于交通银行深圳市分行国际业务部，长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

康乐先生，副总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司副总经理。

刘奇伟先生，副总经理，工商管理硕士。曾担任上海国际信托投资公司实业部高级项目经理，长盛基金监察稽核部副总经理、上海分公司总经理。2005年1月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。历任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

杨皦阳先生，督察长，法学硕士。历任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经

理、总监助理。2008 年 10 月加入本公司，现任公司督察长。

4、本基金现任基金经理简历

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。本基金现任基金经理如下：

徐喻军先生，理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。具有 6 年证券、基金行业从业经验。

5、本基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间 无。

6、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理徐喻军先生兼任上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

1、本基金历任基金经理姓名及管理时间

基金经理姓名	管理时间
江科宏先生	2013 年 5 月 7 日-2015 年 1 月 26 日
徐喻军先生	2014 年 4 月 19 日-至今

8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

许义明先生，总经理；

周伟达先生，副总经理；

毛从容女士，副总经理；

余广先生，股票投资部投资总监；

陈文鹏先生，固定收益部投资总监；

黎海威先生，量化及 ETF 投资部投资总监；

刘彦春先生，研究部总监；

杨鹏先生，股票投资部投资副总监兼基金经理。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### (四) 基金管理人的权利和义务

##### 1、基金管理人的权利

- 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人的利益；
- 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结算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融券；
- 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) 根据法律法规、基金合同、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、收益分配等方面的业务规则；
- 17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

##### 2、基金管理人的义务

- 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) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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开放式基金份额认购价格、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；计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，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) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购或赎回之基金份额的投资人应收对价；
- 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) 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人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人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前提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，将已募集的认购款项、股票连同认购款项的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。

#### (五) 基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，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) 将基金用于下列投资或者活动：
  - (i) 承销证券；
  - (ii) 向他人贷款或者提供担保；
  - (iii) 从事承担无限责任的投资；
  - (iv) 买卖其他基金份额，但是法律法规或国务院另有规定的除外；
  - (v) 向其基金管理人、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者债券；
  - (vi) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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；
  - (vii) 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；
  - (viii) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；
  - (ix) 证券法规规定禁止从事的其他行为。

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) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (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；
- (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；



- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 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；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 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、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不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；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (六) 基金管理人的风险管理和内部控制体系

##### 1、风险管理理念与目标

- (1) 确保合法合规经营；
- (2) 防范和化解风险；
- (3) 提高经营效率；
- (4) 保护投资人和股东的合法权益。

##### 2、风险管理措施

- (1) 建立健全公司组织架构；
- (2) 树立监察稽核功能的权威性和独立性；
- (3) 加强内控培训，培养全体员工的风险管理意识和监察文化；
- (4) 制定员工行为规范和纪律程序；
- (5) 建立岗位分离制度；

(6) 建立危机处理和灾难恢复计划。

### 3、风险管理和内部控制的原则

(1) 全面性原则：公司风险管理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；

(2) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

(3) 相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

(5) 防火墙原则：基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

### 4、内部控制体系

#### I、内部控制的组织架构

(i) 董事会审计与风险控制委员会：负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。该委员会主要职责是：审议并批准公司内控制度和政策并检查其实施情况；监督公司内部审计制度的实施；向董事会提名外部审计机构；负责内部审计和外部审计之间的协调；审议公司的关联交易；对公司的风险及管理状况及风险管理能力及水平进行评价，提出完善风险管理和内部制度的意见、制定公司日常经营、拟募集基金及运用基金资产进行投资的风险控制指标和监督制度，并不定期地对风险控制情况进行检查和监督，形成风险评估报告和建议，在例行董事会会议上提出公司上半个年度风险控制工作总结报告；监督和指导经理层所设立的风险管理委员会的工作及董事会赋予的其他职责。

(ii) 风险管理委员会：是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，负责公司整体运作风险的评估和控制，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金

财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。

(iii) 投资决策委员会：是公司投资领域的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题。投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成，其主要职责包括：依照基金合同、资产管理合同的规定，确立各基金、特定客户资产管理的投资方针及投资方向；审定基金资产、特定客户资产管理的配置方案，包括基金资产、特定客户资产管理在股票、债券、现金之间的配置比例；制定基金、特定客户资产管理投资授权方案；对超出投资负责人权限的投资项目做出决定；考核包括基金经理、投资经理在内的投资团队的工作绩效；需要投资决策委员会决定的其它重大投资事项。

(iv) 督察长：督察长制度是基金管理人特有的制度。督察长负责组织指导公司的监察稽核工作；可列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核；每月独立出具稽核报告，报送中国证监会和董事长。

(v) 法律、监察稽核部：公司设立法律、监察稽核部，开展公司的监察稽核工作，并保证其工作的独立性和权威性，充分发挥其职能作用。法律、监察稽核部有权对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行检查并提出相应意见和建议，并将意见和建议上报公司总经理、督察长和风险管理委员会进行讨论。法律、监察稽核部协助对全公司员工进行相关法律、法规、规章制度培训，回答公司各部门提出的法律咨询，并对公司出现的法律纠纷提出解决方案，同时组织各部门对公司管理上存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究，提出解决方案，提交风险管理委员会、投资决策委员会或总经理办公会等进行审核、讨论，并监督整改。

## II、内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部风险控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到

各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈及日常经营运作；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司在设立部门和岗位时要确保各部门和岗位在职能上保持相对独立并承担各自的风险控制职责，基金资产、受托资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。此外，公司设独立的督察长和法律监察稽核部，督察长和法律监察稽核部在对公司内部控制制度的完善情况和执行情况，对公司内部控制状况的检查监督上具有高度的独立性和权威性；

(4) 相互制约原则：公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化督察长和法律监察稽核部对业务的监督检查功能

(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制订内部控制制度遵循以下原则：

(1) 合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

(2) 全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

(3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

(4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善

口。

### III、内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来，根据中国证监会的要求，借鉴外方股东的经验，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、

严密的内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修改，公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

建立健全了管理制度和业务规章：公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易，交易与清算，公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

建立健全了岗位责任制：公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统：公司启用了电子化投资、交易系统，对投资比例进行限制，在“股票黑名单”、交叉交易以及防范操守风险等方面进行电子化自动控制，将有效地防止合规性运作风险和操守风险。

使用数量化的风险管理手段：采用数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、规避和控制，尽可能减少损失。

提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工具有较高的职业水准，从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书 本公司承

诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

#### 四、基金托管人

## (一) 基金托管人情况

### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009] 13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998] 23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，业务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准 (ISAE3402) 认证，

表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013 年至 2015 年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”，2015 年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 332 只。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业

务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

##### （1）长城证券股份有限公司

注册（办公）地址：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：李春芳 电话：0755-83516089 传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888 网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

##### （2）广发证券股份有限公司



注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄嵐 电话：

020-87555888 传真：

020-87555305 客户

服务电话：95575 网

址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(3) 中国银河证券股份有限公司

注册（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：邓颜

电话：010-66568292 传真：010-66568990 客户服务电话：4008-888-8888 网

址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

客户服务电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(5) 中信建投证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：魏明

电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客户服务电话：4008888108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(6) 申万宏源证券有限公司

注册（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：曹晔

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(7) 招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

客户服务电话：400-8888-111，95565

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(8) 兴业证券股份有限公司

注册（办公）地址：福州市湖东路 268 号 法定代表人：兰荣 联系人：柯延超 联

系电话：0591-38507950 传真：0591-38507538 客户服务电话：95562 网

址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(9) 光大证券股份有限公司

注册（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、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、4008888788、10108998 网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(10) 海通证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市淮海中路 98 号 法定代表人：王开国 联系人：李笑鸣  
电话：021-23219000

传真：021-23219100 客服电话：95553 网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(11) 国信证券股份有限公司

注册（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 电话：0755-82130833 传真：0755-82133952

客户服务电话：95536 网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(12) 华福证券有限责任公司

注册（办公）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

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(13) 华泰证券股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

客户服务电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(14) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010 — 60838995

传真：010 — 60833739

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(15) 长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(16) 东方证券股份有限公司 法定代表人：潘鑫军

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户服务热线：95503

公司网站：<http://www.dfzq.com.cn>

(17) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
(266061)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
(266061)

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月 联系

电话：0532-85022026

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网

址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

## 2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减销售本基金的代理机构，并及时公告。

## (二) 登记结算机构

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 法定代表人：周明 联系人：崔巍 联系电话：010-59378856

## (三) 出具法律意见书的律师事务所 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

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、黎明

联系人：黎明

## (四) 审计基金财产的会计师事务所 名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800  
经办注册会计师：单峰、朱宏宇

## 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 2012 年 11 月 19 日证监许可【2012】1542 号文核准募集。

本基金基金合同已于 2013 年 5 月 7 日起正式生效，本基金募集期共募集 870,515,929.00 份基金份额，有效认购户数为 6,835 户。

### (二) 基金类型

股票型指数基金

### (三) 基金的运作方式

交易型、开放式

### (四) 标的指数

沪深 300 等权重指数

### (五) 基金存续期间

不定期

### (六) 基金份额初始面值

本基金基金份额的发售面值为人民币 1.00 元

### (七) 基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币。

### (八) 募集方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资人通过基金管理人以现金进行的认购。

网下股票认购是指投资人通过基金管理人或其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构 确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。

#### (九) 募集场所

投资人应当在基金管理人或其指定发售代理机构办理基金发售业务的营 业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构办理可接受的认购方式等基金发售业务的具体 情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增加或变更发售代理机构，并另行公告。

#### (十) 募集期限

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金将自 2013 年 3 月 25 日起至 2013 年 4 月 26 日进行发售。本基金的 发售方式有三种：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。

网上现金认购的日期为 2013 年 3 月 25 日起至 2013 年 4 月 26 日，如证券 交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将做出相应调整并及时公告；

网下现金认购的日期为 2013 年 3 月 25 日起至 2013 年 4 月 26 日；

网下股票认购的日期为 2013 年 4 月 22 日起至 2013 年 4 月 26 日。

基金管理人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（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时公告。投资人认购应提 交的文件和办理的手续详见基金份额发售公告。

#### (十一) 募集对象

中国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格 境外机构投资者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。

#### (十二) 认购开户

1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深 圳 A 股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券投 资基金账户”）。

(1)已有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资人不必再办理开户 手续。

(2)尚无深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户的投资人，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深圳分公司的开户代理机构办理深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳 A 股账户和深圳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。

## 2、账户使用注意事项

(1)如投资人需要参与网下现金认购或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。

(3)如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了需持有深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以认购基金份额的深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户的托管证券公司与上海 A 股账户指定交易的证券公司应为同一发售代理机构。

(4)如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳 A 股账户与上海 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商，否则无法办理本基金的申购和赎回。

(5)已通过二级市场购买过景顺长城鼎益基金（LOF）、景顺长城资源垄断基金（LOF）的投资人，其所持有的深圳 A 股账户或证券投资基金账户可用于认购本基金。

(6)已购买过由景顺长城基金管理有限公司担任登记结算机构的基金的投资人，其所持有的景顺长城基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

## （十三）认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照下表费率收取认购费用。



发售代理机构办理网上现金认购、网下股票认购时，可参照下表费率结构收取一定的佣金。

认购份额	认购费率
50 万份以下	1.0%
50 万份以上(含 50 万份)_100 万份以下	0.5%
100 万份以上(含 100 万份)	每笔 1000 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、登记结算等基金募集期间发生的各项费用。

#### (十四) 网上现金认购

1、认购时间：网上现金认购的日期为 2013 年 3 月 25 日起至 2013 年 4 月 26 日。

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 1000 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、认购申请：认购费用由发售代理机构在投资人认购时收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认购手续。投资人可多次提出认购申请，认购一经受理不可撤销，认购资金即被冻结。

#### 4、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额=认购价格 x 认购份额 X(1 + 佣金比率)

认购佣金=认购价格 x 认购份额 X 佣金比率

利息折算的份额=利息 / 认购价格

网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金 100,000 份，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 1%，则需准备的资金数额计算如下：

认购金额=1.00X100,000 X ( 1 + 1 % ) =101,000 元

认购佣金=1.00X 100,000X1% = 1,000 元

又假设该笔资金在募集期间产生了 10.8 元的利息，则利息折算的份额= $10.8 / 1.00=10$  份(保留至整数位)

即，若该投资人通过发售代理机构认购本基金份额 100,000 份，则需缴纳 认购金额 101,000 元，其中认购佣金 1,000 元，并可获得利息折算的份额 10 份。

#### (十五) 网下现金认购

1、认购时间：网下现金认购的日期为 2013 年 3 月 25 日起至 2013 年 4 月 26 日。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人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)。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购手续：认购费用由基金管理人在投资人认购时收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。投资人在认购本基金时，需按基金管理人的规定办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请一经受理不得撤销。

#### 4、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额=认购价格 X 认购份额 X (1 + 认购费率)

认购费用=认购价格 X 认购份额 X 认购费率

利息折算的份额=利息 / 认购价格

网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过基金管理人认购本基金 500,000 份，认购费率为 0.5%，则该投资人的认购金额为：

认购金额=  $1.00 \times 500,000 \times (1 + 0.5\%) = 502,500$  元

认购费用=  $1.00 \times 500,000 \times 0.5\% = 2,500$  元

又假设该笔资金在募集期间产生了 55.8 元的利息，则利息折算的份额= $55.8 / 1.00 = 55$  份(保留至整数位)

即，若该投资人通过基金管理人认购本基金 500,000 份，则需缴纳认购金额

502,500 元，其中认购费用 2,500 元，并可获得利息折算的份额 55 份。

5、T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人确认后，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

#### (十六) 网下股票认购

1、认购时间：网下股票认购的日期为 2013 年 4 月 22 日起至 2013 年 4 月 26 日。

2、认购限额：

以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是沪深 300 等权重指数成份股和已公告的备选成份股（基金管理人公告限制的除外）。单只股票最低认购申报股数为 1000 股，超过 1000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：

认购费用由发售代理机构或基金管理人在投资人认购时收取。投资人认购本基金时，需按销售机构的规定，到基金销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请一经受理不得撤销，投资人申报的股票予以冻结。投资人的认购股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的权益归投资人所有。

4、特别提示：投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

5、特殊情形

(1)已公告的将被调出沪深 300 等权重指数的成份股不得用于认购本基金。

(2)限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少 3 日公告限制认购规模的个股名单。

(3)临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

6、清算交收：T 日日终(T 日为本基金发售期最后一日)，发售代理机构将股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票

过户至本基金组合证券认购专户。基金管理人为投资人计算认购份 额，并根据发 售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的佣 金，从投资人的认 购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额，登记 结算机构根据基金管 理人提供的有效认购申请股票数据，将上海和深圳的股票 分别过户至本基金在上 海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后，登记结算 机构根据基金管理人提供 的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额 的初始登记。

在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金 份 额的方式支付认购费用。

7、认购份额的计算公式：

投资人的认购份额第 i 只股票在 T 日的均价 x 有效认购数量)/1.00

其中，

(1)  $i$  代表投资人提交认购申请的第  $i$  只股票，如投资人仅提交了 1 只股票的申 请，则  $i = 1, \dots, 300$ 。

(2) “第  $i$  只股票在 T 日的均价”由基金管理人根据深圳证券交易所及上海证 券交易所的 T 日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四 舍 五入的方法保留小数点后两位。若该股票在 T 日停牌或无成交，则以同样方 法计 算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在 T 日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、 送 股(转增)、配股等权益变动，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人 将按 如下方式对该股票在 T 日的均价进行调整：

①除息：调整后价格=T 日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=T 日均价/(1+每股送股比例)

③配股：调整后价格=(T 日均价+配股价 x 配股比例)/(1 +每股配股比例)

④送股且配股：调整后价格=(T 日均价+配股价 x 配股比例)/(1 +每股送股 比 例+每股配股比例)

⑤除息且送股：调整后价格=(T 日均价-每股现金股利或股息) / (1+ 每 股 送股比例)

⑥除息且配股：调整后价格=(T 日均价+配股价 x 配股比例-每股现金股利 或股息)

$/(1+\text{每股配股比例})$

⑦除息、送股且配股：调整后价格=(T 日均价+配股价 x 配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构完成清算 交收的股票股数。其中，

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限

公式：

$$Q_{ms} = \frac{Cash + (P_{jij} - P) \times 105\% \times W}{P}$$

$Q_{ms}$ ：限制认购规模的单个个股最高可确认的认购数量；

$Cash$ ：网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；

$P_{jij}$ ：除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股 以外的其他个股当日均价和认购申报数量乘积；

$W$ ：该股按均价计算的其在网下股票认购日沪深 300 等权重指数中的权重，（认购期间如有沪深 300 等权重指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的 成份股名单以及沪深 300 等权重指数编制规则计算调整后的沪深 300 等权重指 数构成权重，并以其作为计算依据）；

$P$ ：该股在网下股票认购日的均价。

如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量 上限，则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股 认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的，则按比例分配确认。

②若某一股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结 期间发生司法冻结或执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户 数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

## 8、认购费用（佣金）

□如投资人以现金支付认购费用/佣金，则其可得的基金份额和需支付的认 购费用/佣金为：

$$\text{认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票认购末日均价} \times \text{有效认购数量}) / \text{认购价格} - \text{认购费用} / \text{佣金}$$

$$\text{佣金} = \text{认购份额} / (1 + \text{认购费率}) \times \text{认购费率} \times \text{认购价格}$$
 如投资人以基金份额方式交纳认购费用/佣金，则其可得的基金份额和需支

付的认购费用/佣金为：

$$\text{认购份额} = S (\text{第 } i \text{ 只股票认购末日均价} \times \text{有效认购数量}) / \text{认购价格} - \text{认购费用} / \text{佣金}$$

$$\text{佣金} = \text{认购份额} / (1 + \text{认购费率}) \times \text{认购费率}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购费用} / \text{佣金}$$

投资人网下股票认购时缴交的认购费用/佣金的计算保留到整数位，小数点 后部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

例：某投资人通过基金管理人以股票 A 2,000 股及股票 B 1,000 股认购本基金，假定认购末日股票 A 的均价为 3.72 元/股，股票 B 的均价为 35.50 元/股，对应认购费率为 1.0%，则该投资人应当支付的认购费用/佣金以及净认购份额

①以现金支付认购费用/佣金的情况下：

$$\text{认购份额} = (3.72 \times 2,000 + 35.5 \times 1,000) / 1.00 = 42,940 \text{ 份}$$

$$\text{认购费用/佣金} = 42,940 / (1 + 1\%) \times 1\% = 425 \text{ 元 (保留至整数位)}$$

即，若该投资人通过基金管理人以上述股票认购本基金，则需缴纳认购费用/佣金 425 元，方可获得本基金份额 42,940 份。

以基金份额方式支付认购费用/佣金的情况下：

$$\text{认购份额} = (3.72 \times 2,000 + 35.5 \times 1,000) / 1.00 = 42,940 \text{ 份}$$

$$\text{认购费用/佣金} = 42,940 / (1 + 1\%) \times 1\% = 425 \text{ 份 (保留至整数位)}$$

净认购份额 = 42,940 - 425 = 42,515 份

即，若该投资人通过基金管理人以上述股票认购本基金，则需从认购份额中扣除 425 份用以支付认购费用/佣金，方可获得本基金份额 42,515 份。

**注：代销机构对认购费用/佣金另有计算方式的，从其规定。**

(十七) 募集资金利息及募集股票权益的处理 认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归投资人所有。

基金网下股票认购所募集的股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的孳息归认购投资人本人所有。

#### (十八) 募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。基金网下股票认购所募集的认购股票予以冻结。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。

### 七、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（含网下股票认购所募集的股票市值）且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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（包括一种或多种认购方式），并在 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，网下股票认购所募集的股票予以冻结，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 日内退还投资人已缴纳的认购款项、股票及认购款项的银行同期存款利息，登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。
- 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) 基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2013 年 5 月 7 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

#### (四) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。

### （一）基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

### （二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### （三）基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请基金份额上市：

- 1、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不低于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人不少于 1,000 人；
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金份额上市日的 3 个工作日前发布基



金份额上市交易公告书。

本基金于 2013 年 6 月 5 日起在深圳证券交易所上市交易，二级市场交易代码：159924。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

## (二)基金份额的交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易、暂停或终止上市交易，应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其他有关规定。

## (三)基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司在相关证券交易所开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV）并由深圳证券交易所在交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。

### 1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值=(申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中禁用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中的预估现金差额)/最小申购赎回单位对应的基金份额。

### 2、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。 十、基金份额的申购、赎回和非交易过户

## (一) 申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并予以公告。

投资人可以通过基金管理人直销中心办理基金申购、赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。

## (二) 申购和赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

基金投资人办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所及上

海证券交易所的交易日，具体办理时间为相关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，若出现相关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；若证券交易场所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，基金管理人在次日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

本基金基金合同于 2013 年 5 月 7 日起正式生效。根据《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本公司已于 2013 年 6 月 5 日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。

### (三) 申购和赎回的数额限制

投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为 200 万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定指定媒体公告并报中国证监会备案。

### (四) 申购和赎回的原则

- 1、申购、赎回应遵守《登记结算业务实施细则》及其他相关规定。
- 2、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
- 3、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 4、申购、赎回申请提交后不得撤销。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (五) 申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回申请的提出

- (1) 投资人办理申购或赎回业务，应同时持有并使用深圳 A 股账户和上海 A 股账户，并保证该两个账户的证件号码和名称属于同一投资人所有；
- (2) 投资人的相关证券和基金份额应当托管在申购赎回代理券商，且投资人

深圳 A 股账户的托管单元与上海 A 股账户指定交易的交易单元为同一申购赎回代理券商；

(3) 投资人通过该申购赎回代理券商申报申购、赎回业务。

基金投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。

## 2、申购和赎回申请的确认

基金投资人申购、赎回申请在 T+1 日进行确认。

对于投资人提交的申购申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的申购申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的组合证券、现金替代款和预估现金差额，登记结算机构在完成 T 日全部登记结算业务处理后，对申请申购的组合证券予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1 日，基金管理人对于冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，则申购申请失败。

对于投资人提交的赎回申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的赎回申请以及 T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的基金份额、预估现金差额，登记结算机构在完成 T 日全部登记结算业务处理后，对申请赎回的基金份额予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1 日，基金管理人根据冻结情况对投资人的赎回申请予以确认。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

投资人可在 T+2 日及之后通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资人应及时查询有关申请的确认情况。

## 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。

T+1 日，登记结算机构根据基金管理人对于申购、赎回申请的确认信息，为投资人办理组合证券、基金份额的清算交收，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资人 T 日申购所得的基金

份额、赎回所得的组合证券在 T+2 日可用。现金替代和现金差额由基金管理人与申购赎回代理券商于 T+1 日进行清算，T+2 日进行交收，登记结算机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请，登记结算机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻，申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。

如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的其他情形，则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

若投资人用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记结算机构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资人进行赔偿。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

#### (六) 申购、赎回的对价、费用

1、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人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。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前通知深圳证券交易所及登记结算机构，并在深圳证券交易所及基金管理人网站公告。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关

费用。

### (七) 申购赎回清单的内容与格式

#### 1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单内容包括最小申购赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

#### 2、组合证券

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

#### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、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。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资人的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。

(1) 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代(标志为“禁止”)、可以现金替代(标志为“允许”)和必须现金替代(标志为“必须”)。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

#### (2) 可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量 X 该证券经除权调整的 T-1 日收盘价 X (1+现金替代保证金率)

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管

理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

### ③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此在 T+2 日收取替代金额。

在 T+1 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+3 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+3 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+3 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特例情况：若自 T+1 日起，相关证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

T+3 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T+1 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人，现金替代多退少补资金的清算和交收在 T+3 日后 2 个工作日（若在特例情况下，则为 T+1 日起第 22 个交易日）内完成，登记结算机构对此提供代收代付服务。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例} = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只替代证券数} \times \text{该证券经除权调整的收盘价}}{\text{申购基金份额} \times \text{基金份额净值}}$$

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

### (3)必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是因标的指数调整将被剔除、或基金管

理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的 T-1 日收盘价。

#### 4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是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，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

$T$  日预估现金差额=  $T-1$  日最小申购赎回单位的基金资产净值<sub>T-1</sub> (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)

其中， $T$  日经除权调整后的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数成份证券调整后开盘参考价确定。另外，若  $T$  日为基金分红除息日，则计算公式中的“ $T-1$  日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

$T$  日现金差额在  $T+1$  日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

$T$  日现金差额= $T$  日最小申购赎回单位的资产净值<sub>T</sub> -(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与  $T$  日收盘价乘积之和)

$T$  日投资人申购、赎回基金份额时，需按  $T+1$  日公告的  $T$  日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 6、申购赎回清单的格式

T 日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期：	
基金名称：	
基金管理公司名称：	
基金代码：	
拟合指数代码：	



T-1 日信息内容					
现金差额：					
最小申购、赎回单位资产净值：					
基金份额净值：					
T 日信息内容					
预估现金差额：					
可以现金替代比例上限：					
是否需要公布 IOPV：					
最小申购、赎回单位：					
最小申购赎回单位现金红利：					
申购赎回组合证券只数：					
是否开放申购：					
是否开放赎回：					
是否开放保证金申购：					
组合信息内容					
证券代码	证券简称	股票数量	现金替代标志	现金替代 保证金率	固定替代 金额
000001	平安银行		允许	21.00%	
000002	万科 A		允许	21.00%	
000009	中国宝安		允许	21.00%	
000027	深圳能源		允许	21.00%	
000039	中集集团		允许	21.00%	
000046	泛海控股		允许	21.00%	
000060	中金岭南		允许	21.00%	
000061	农产品		允许	21.00%	
000063	中兴通讯		允许	21.00%	
000069	华侨城 A		允许	21.00%	
000100	TCL 集团		允许	21.00%	
000156	华数传媒		允许	21.00%	
000157	中联重科		允许	21.00%	
000166	申万宏源		允许	21.00%	
000333	美的集团		允许	21.00%	
000338	潍柴动力		允许	21.00%	
000402	金融街		允许	21.00%	
000413	东旭光电		允许	21.00%	
000415	渤海金控		允许	21.00%	
000423	东阿阿胶		允许	21.00%	
000425	徐工机械		允许	21.00%	
000503	海虹控股		允许	21.00%	
000538	云南白药		允许	21.00%	
000540	中天城投		允许	21.00%	
000559	万向钱潮		允许	21.00%	
000568	泸州老窖		允许	21.00%	

000623	吉林敖东		允许	21.00%	
000625	长安汽车		允许	21.00%	
000630	铜陵有色		允许	21.00%	
000651	格力电器		允许	21.00%	
000686	东北证券		允许	21.00%	
000709	河钢股份		允许	21.00%	
000712	锦龙股份		允许	21.00%	
000725	京东方 A		允许	21.00%	
000728	国元证券		允许	21.00%	
000729	燕京啤酒		允许	21.00%	
000738	中航动控		允许	21.00%	
000750	国海证券		允许	21.00%	
000768	中航飞机		允许	21.00%	
000776	广发证券		允许	21.00%	
000778	新兴铸管		允许	21.00%	
000783	长江证券		允许	21.00%	
000792	盐湖股份		允许	21.00%	
000793	华闻传媒		允许	21.00%	
000800	一汽轿车		允许	21.00%	
000825	太钢不锈		允许	21.00%	
000826	启迪桑德		允许	21.00%	
000839	中信国安		允许	21.00%	
000858	五粮液		允许	21.00%	
000876	新希望		允许	21.00%	
000883	湖北能源		允许	21.00%	
000895	双汇发展		允许	21.00%	
000898	鞍钢股份		允许	21.00%	
000917	电广传媒		允许	21.00%	
000963	华东医药		允许	21.00%	
000977	浪潮信息		允许	21.00%	
000999	华润三九		允许	21.00%	
001979	招商蛇口		允许	21.00%	
002007	华兰生物		允许	21.00%	
002008	大族激光		允许	21.00%	
002024	苏宁云商		允许	21.00%	
002027	分众传媒		允许	21.00%	
002065	东华软件		允许	21.00%	
002081	金螳螂		允许	21.00%	
002129	中环股份		允许	21.00%	
002142	宁波银行		允许	21.00%	
002146	荣盛发展		允许	21.00%	
002152	广电运通		允许	21.00%	
002153	石基信息		允许	21.00%	

002183	怡亚通		允许	21.00%	
002195	二三四五		允许	21.00%	
002202	金风科技		允许	21.00%	
002230	科大讯飞		允许	21.00%	
002236	大华股份		允许	21.00%	
002241	歌尔股份		允许	21.00%	
002252	上海莱士		允许	21.00%	
002292	奥飞娱乐		允许	21.00%	
002294	信立泰		允许	21.00%	
002304	洋河股份		允许	21.00%	
002385	大北农		允许	21.00%	
002399	海普瑞		允许	21.00%	
002415	海康威视		允许	21.00%	
002422	科伦药业		允许	21.00%	
002424	贵州百灵		允许	21.00%	
002450	康得新		允许	21.00%	
002456	欧菲光		允许	21.00%	
002465	海格通信		允许	21.00%	
002470	金正大		允许	21.00%	
002475	立讯精密		允许	21.00%	
002500	山西证券		允许	21.00%	
002568	百润股份		允许	21.00%	
002594	比亚迪		允许	21.00%	
002673	西部证券		允许	21.00%	
002736	国信证券		允许	21.00%	
002739	万达院线		允许	21.00%	
300002	神州泰岳		允许	21.00%	
300003	乐普医疗		允许	21.00%	
300015	爱尔眼科		允许	21.00%	
300017	网宿科技		允许	21.00%	
300024	机器人		允许	21.00%	
300027	华谊兄弟		允许	21.00%	
300058	蓝色光标		允许	21.00%	
300059	东方财富		允许	21.00%	
300070	碧水源		允许	21.00%	
300085	银之杰		允许	21.00%	
300104	乐视网		允许	21.00%	
300124	汇川技术		允许	21.00%	
300133	华策影视		允许	21.00%	
300144	宋城演艺		允许	21.00%	
300146	汤臣倍健		允许	21.00%	
300168	万达信息		允许	21.00%	
300251	光线传媒		允许	21.00%	

300315	掌趣科技		允许	21.00%	
600000	浦发银行		允许	21.00%	
600005	武钢股份		允许	21.00%	
600008	首创股份		允许	21.00%	
600009	上海机场		允许	21.00%	
600010	包钢股份		允许	21.00%	
600011	华能国际		允许	21.00%	
600015	华夏银行		允许	21.00%	
600016	民生银行		允许	21.00%	
600018	上港集团		允许	21.00%	
600019	宝钢股份		允许	21.00%	
600021	上海电力		允许	21.00%	
600022	山东钢铁		允许	21.00%	
600023	浙能电力		允许	21.00%	
600027	华电国际		允许	21.00%	
600028	中国石化		允许	21.00%	
600029	南方航空		允许	21.00%	
600030	中信证券		允许	21.00%	
600031	三一重工		允许	21.00%	
600036	招商银行		允许	21.00%	
600037	歌华有线		允许	21.00%	
600038	中直股份		允许	21.00%	
600048	保利地产		允许	21.00%	
600050	中国联通		允许	21.00%	
600060	海信电器		允许	21.00%	
600061	国投安信		允许	21.00%	
600066	宇通客车		允许	21.00%	
600068	葛洲坝		允许	21.00%	
600074	保千里		允许	21.00%	
600085	同仁堂		允许	21.00%	
600089	特变电工		允许	21.00%	
600098	广州发展		允许	21.00%	
600100	同方股份		允许	21.00%	
600104	上汽集团		允许	21.00%	
600109	国金证券		允许	21.00%	
600111	北方稀土		允许	21.00%	
600115	东方航空		允许	21.00%	
600118	中国卫星		允许	21.00%	
600150	中国船舶		允许	21.00%	
600153	建发股份		允许	21.00%	
600157	永泰能源		允许	21.00%	
600170	上海建工		允许	21.00%	
600177	雅戈尔		允许	21.00%	

600188	兖州煤业		允许	21.00%	
600196	复星医药		允许	21.00%	
600208	新湖中宝		允许	21.00%	
600221	海南航空		允许	21.00%	
600252	中恒集团		允许	21.00%	
600256	广汇能源		允许	21.00%	
600271	航天信息		允许	21.00%	
600276	恒瑞医药		允许	21.00%	
600309	万华化学		允许	21.00%	
600317	营口港		允许	21.00%	
600332	白云山		允许	21.00%	
600340	华夏幸福		允许	21.00%	
600352	浙江龙盛		允许	21.00%	
600362	江西铜业		允许	21.00%	
600369	西南证券		允许	21.00%	
600372	中航电子		允许	21.00%	
600373	中文传媒		允许	21.00%	
600376	首开股份		允许	21.00%	
600383	金地集团		允许	21.00%	
600398	海澜之家		允许	21.00%	
600406	国电南瑞		允许	21.00%	
600415	小商品城		允许	21.00%	
600446	金证股份		允许	21.00%	
600485	信威集团		允许	21.00%	
600489	中金黄金		允许	21.00%	
600518	康美药业		允许	21.00%	
600519	贵州茅台		允许	21.00%	
600535	天士力		允许	21.00%	
600547	山东黄金		允许	21.00%	
600570	恒生电子		允许	21.00%	
600578	京能电力		允许	21.00%	
600582	天地科技		允许	21.00%	
600583	海油工程		允许	21.00%	
600585	海螺水泥		允许	21.00%	
600588	用友网络		允许	21.00%	
600600	青岛啤酒		允许	21.00%	
600606	绿地控股		允许	21.00%	
600637	东方明珠		允许	21.00%	
600642	申能股份		允许	21.00%	
600648	外高桥		允许	21.00%	
600649	城投控股		允许	21.00%	
600660	福耀玻璃		允许	21.00%	
600663	陆家嘴		允许	21.00%	

600666	奥瑞德		允许	21.00%	
600674	川投能源		允许	21.00%	
600685	中船防务		允许	21.00%	
600688	上海石化		允许	21.00%	
600690	青岛海尔		允许	21.00%	
600703	三安光电		允许	21.00%	
600704	物产中大		允许	21.00%	
600705	中航资本		允许	21.00%	
600718	东软集团		允许	21.00%	
600737	中粮屯河		允许	21.00%	
600739	辽宁成大		允许	21.00%	
600741	华域汽车		允许	21.00%	
600783	鲁信创投		允许	21.00%	
600795	国电电力		允许	21.00%	
600804	鹏博士		允许	21.00%	
600816	安信信托		允许	21.00%	
600820	隧道股份		允许	21.00%	
600827	百联股份		允许	21.00%	
600837	海通证券		允许	21.00%	
600839	四川长虹		允许	21.00%	
600863	内蒙华电		允许	21.00%	
600867	通化东宝		允许	21.00%	
600871	石化油服		允许	21.00%	
600873	梅花生物		允许	21.00%	
600875	东方电气		允许	21.00%	
600886	国投电力		允许	21.00%	
600887	伊利股份		允许	21.00%	
600893	中航动力		允许	21.00%	
600895	张江高科		允许	21.00%	
600900	长江电力		允许	21.00%	
600958	东方证券		允许	21.00%	
600959	江苏有线		允许	21.00%	
600998	九州通		允许	21.00%	
600999	招商证券		允许	21.00%	
601006	大秦铁路		允许	21.00%	
601009	南京银行		允许	21.00%	
601016	节能风电		允许	21.00%	
601018	宁波港		允许	21.00%	
601021	春秋航空		允许	21.00%	
601088	中国神华		允许	21.00%	
601098	中南传媒		允许	21.00%	
601099	太平洋		允许	21.00%	
601106	中国一重		允许	21.00%	

601111	中国国航		允许	21.00%	
601117	中国化学		允许	21.00%	
601118	海南橡胶		允许	21.00%	
601166	兴业银行		允许	21.00%	
601169	北京银行		允许	21.00%	
601179	中国西电		允许	21.00%	
601186	中国铁建		允许	21.00%	
601198	东兴证券		允许	21.00%	
601211	国泰君安		允许	21.00%	
601216	君正集团		允许	21.00%	
601225	陕西煤业		允许	21.00%	
601258	庞大集团		允许	21.00%	
601288	农业银行		允许	21.00%	
601318	中国平安		允许	21.00%	
601328	交通银行		允许	21.00%	
601333	广深铁路		允许	21.00%	
601336	新华保险		允许	21.00%	
601377	兴业证券		允许	21.00%	
601390	中国中铁		允许	21.00%	
601398	工商银行		允许	21.00%	
601555	东吴证券		允许	21.00%	
601600	中国铝业		允许	21.00%	
601601	中国太保		允许	21.00%	
601607	上海医药		允许	21.00%	
601608	中信重工		允许	21.00%	
601618	中国中冶		允许	21.00%	
601628	中国人寿		允许	21.00%	
601633	长城汽车		允许	21.00%	
601668	中国建筑		允许	21.00%	
601669	中国电建		允许	21.00%	
601688	华泰证券		允许	21.00%	
601718	际华集团		允许	21.00%	
601727	上海电气		允许	21.00%	
601766	中国中车		允许	21.00%	
601788	光大证券		允许	21.00%	
601800	中国交建		允许	21.00%	
601808	中海油服		允许	21.00%	
601818	光大银行		允许	21.00%	
601857	中国石油		允许	21.00%	
601866	中海集运		允许	21.00%	
601872	招商轮船		允许	21.00%	
601888	中国国旅		允许	21.00%	
601898	中煤能源		允许	21.00%	

601899	紫金矿业		允许	21.00%	
601901	方正证券		允许	21.00%	
601919	中国远洋		允许	21.00%	
601928	凤凰传媒		允许	21.00%	
601933	永辉超市		允许	21.00%	
601939	建设银行		允许	21.00%	
601958	金铂股份		允许	21.00%	
601985	中国核电		允许	21.00%	
601988	中国银行		允许	21.00%	
601989	中国重工		允许	21.00%	
601991	大唐发电		允许	21.00%	
601992	金隅股份		允许	21.00%	
601998	中信银行		允许	21.00%	
603000	人民网		允许	21.00%	
603885	吉祥航空		允许	21.00%	
603993	洛阳钼业		允许	21.00%	

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

#### (A)拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或者暂停接受投资人的申购、赎回申请

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法正常运作或无法受理投资人的申购、赎回申请；
- 2、因特殊原因（包括但不限于相关证券交易场所依法决定临时停市或在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；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单；
- 5、相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 6、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某些或某笔申购；
- 7、基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人或者其他申购、赎回投资人



利益的其他情形；

8、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一（第 6 项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时，基金管理人应当及时公告并向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

(九) 基金的非交易过户、冻结与解冻

登记结算机构可根据其业务规则受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并按照规定收取一定的手续费用。

## 十一、基金的投资

(一) 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。

(二) 投资理念

中国经济和资本市场将保持长期稳定的发展，指数化投资可以以较低的成本获得市场平均水平的长期回报。本基金的标的指数具有良好的市场代表性，以等权重方式组成，通过完全复制法追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，可以满足投资人多种投资需求。

(三) 投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证

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。

#### （四）投资策略

本基金以沪深 300 等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑）或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### （五）投资决策流程

投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题，包括确立各基金的投资方针及投资方向，审定基金财产的配置方案。投资决策委员会召开前，由基金经理依据对宏观经济走势的分析，提出基金的资产配置建议，交由投资决策委员会讨论。一旦做出决议，即成为指导基金投资的正式文件，投资部据此拟订具体的投资计划。

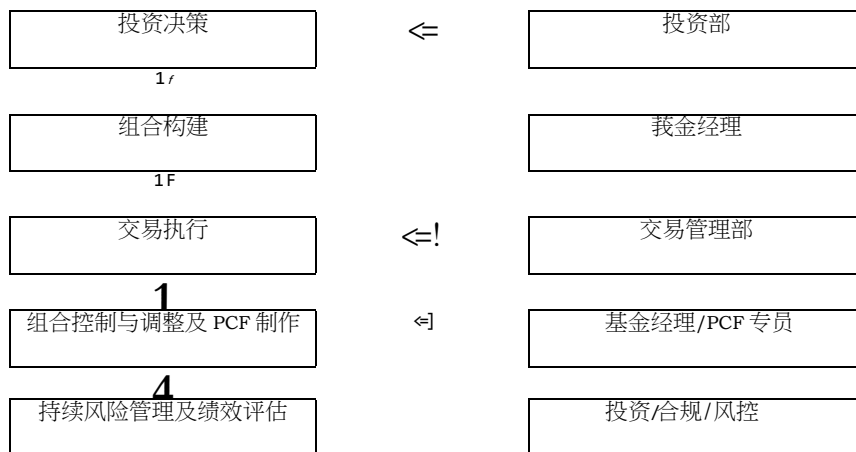
投资研究部是负责管理基金日常投资活动的具体部门，分管投资的副总经理除履行投资决策委员会执行委员的职责外，还负责管理和协调投资研究部的日常运作。投资研究联席会议是投资研究部常设议事机构，负责讨论行业信息、个股信息、回顾行业表现、行业配置、模拟组合表现、近期研究计划及成果、市场热点、当日投资决策、代行表决权、投资备选库调整等问题。投资研究部主要负责

宏观经济研究、行业研究和投资品种研究，负责编制、维护投资备选库，建立、完善、管理并维护股票研究数据库与债券研究资料库，并为投资决策委员会、投资研究联席会议、分管投资的副总经理、各投资总监和基金经理提供基金投资决策依据。投资研究部负责根据投资决策委员会决议，负责基金投资组合的构造、优化、风险管理及头寸管理等日常工作；拟订基金的总体投资策略、资产配置方案、重大投资项目提案和投资组合方案等并上报投资决策委员会讨论决定；组织实施投资决策委员会及投资研究联席会议决定的投资方案并在授权范围内作出投资决定；依据自主的研究积极把握市场动态，积极提出基金投资组合优化方案，并对管理基金的投资业绩负责。其中基金经理根据投资决策委员会及投资研究联席会议决议具体承担本基金的日常管理工作。

风险管理委员会是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。绩效评估与风险控制人员负责建立和完善投资风险管理系统，并负责对基金历史业绩进行分解和分析。法律、监察稽核部负责基金日常运作的合规控制。

投资决策流程

基金投资流程示意图



(1) 投资决策。投资决策委员会定期不定期召开投资决策委员会会议，对相关重大事项做出决策。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。

(2) 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，控制投资风险。

(3) 交易执行。交易管理部负责基金的具体交易执行，同时履行一线监控的职责。

(4) 组合监控与调整。基金经理在指数编制方法发生变更、指数成份股定期或临时调整、指数成份股出现股本变化、增发、配股等情形、成份股停牌、成份股流动性不足、基金申购赎回出现的现金流量等情形下，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数，同时 PCF 专员制作下一交易日 PCF 清单。

(5) 持续风险管理及绩效评估。基金经理及风险管理人员定期不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估。风险管理管理人员负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员。基金经理依据绩效评估报告对投资进行总结或检讨，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

基金管理人在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。

#### (六) 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：沪深 300 等权重指数。

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他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金经理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序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），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

#### （七）风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，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。

#### （A）投资组合管理

本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在沪深 300 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合。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，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制，实现对标的指数的紧密跟踪。

##### 1、标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

##### 2、指数编制方法发生变更

基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整。

##### 3、成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

##### 4、标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

##### 5、申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影

响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

#### 6、跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及原因，并优化跟踪偏离度管理方案，同时设置风险隐患预警机制，及时控制跟踪偏离度和跟踪误差。

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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。

#### (九) 投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

本基金从事股票指数期货投资时，遵循相关法律法规的规定：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%；本基金在任何交易日日终，持有的买入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；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金所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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金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%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入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；

(4) 本基金参与股票发行申购，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；

(5) 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：

(6) 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。

(7) 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%。

(8) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(9) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

(10) 法律法规规定或基金合同约定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)-(3)项以及(6)-(8)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门变更或取消上述限制，履行适当程序后，本基金可相应变更或取消上述规定限制。

#### (十) 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，但是法律法规或国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的

股票或者债券；

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；

7、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；

8、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。

对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

若法律法规或监管部门变更或取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金可相应变更或取消上述规定限制。

#### （十一）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，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。

5、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### （十二）基金投资组合报告

景顺长城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。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。



## 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	67,896,281.10	98.20
	其中：股票	67,896,281.10	98.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,239,058.80	1.79
8	其他资产	1,960.20	0.00
9	合计	69,137,300.10	100.00

## 2.报告期末按行业分类的股票投资组合 等权重交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书

### 2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	240,206.70	0.35
B	采矿业	3,534,500.62	5.15
C	制造业	27,008,158.16	39.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,965,549.56	5.78
E	建筑业	2,624,532.33	3.82
F	批发和零售业	2,501,638.16	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	251,637.81	4.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,474,515.39	7.98
J	金融业	10,408,321.68	15.16
K	房地产业	3,522,436.59	5.13
L	租赁和商务服务业	1,603,179.56	2.34
M	科学研究和技术服务		
N	水利、环境和公共设施管理业	745,008.30	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	232,344.16	0.34
R	文化、体育和娱乐业	2,100,218.52	3.06
S	综合	684,033.56	1.00
	合计	67,896,281.10	98.91

### 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 本基金

本报告期末未持有积极投资的股票。

### 2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 3. 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

#### 3.1 报告期末指数投资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	000413	东旭光电	26,483	384,268.33	0.56
2	000839	中信国安	29,750	332,902.50	0.48
3	002424	贵州百灵	13,600	300,152.00	0.44
4	600068	葛洲坝	37,844	299,346.04	0.44
5	600188	兖州煤业	23,400	291,330.00	0.42
6	600547	山东黄金	7,500	286,425.00	0.42
7	000423	东阿阿胶	4,806	285,957.00	0.42
8	600309	万华化学	13,868	285,126.08	0.42
9	601216	君正集团	57,896	282,532.48	0.41
10	600489	中金黄金	23,276	282,337.88	0.41

#### 3.2 报告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的股票。

#### 4. 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。

#### 5. 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。

#### 6. 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。

#### 7. 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。

#### 8. 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。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 9.1 报告期

##### 末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注 11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,648.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	311.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,960.20

## 11.4 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。

## 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 11.5.1 报告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中不存在流通受限的情况。

### 11.5.2 报告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的股票。

## 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十二、

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。待基金参与融资融券业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

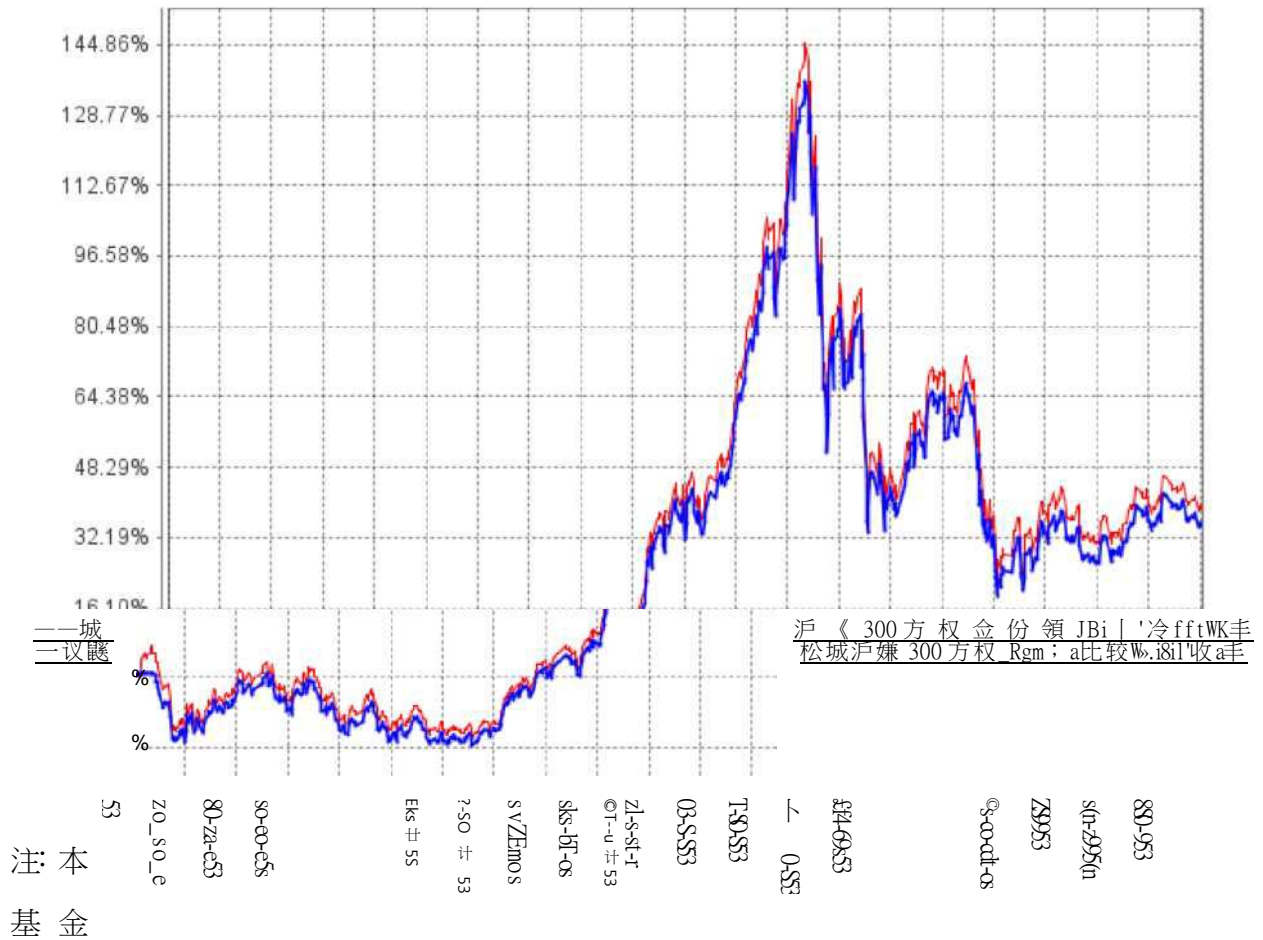
## 十三、基金的业绩

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。基金业绩数据截至 2016 年 9 月 30 日。

### 1、净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2013 年 5 月 7 日至 2013 年 12 月 31 日	-6.20%	1.29%	-3.61%	1.37%	-2.59%	-0.08%
2014 年	44.03%	1.15%	43.73%	1.17%	0.30%	-0.02%
2015 年	18.73%	2.57%	20.12%	2.62%	-1.39%	-0.05%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日	-15.27%	1.79%	-15.95%	1.83%	0.68%	-0.04%
2013 年 5 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日	35.90%	1.83%	39.87%	1.87%	-3.97%	-0.04%

## 2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



的资产配置比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及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）。本基金的建仓期为自 2013 年 5 月 7 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

## 十四、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款项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结算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、基金登记结算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。

## 十五、基金资产的估值

### (一) 估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### (二) 估值日



本基金的估值日为相关的证券交易所的正常交易日，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。

### (三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### (四) 估值方法

#### 1、股票估值方法：

##### (1) 上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

##### (2) 未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值

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，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 基金管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值方法：

(1) 在证券交易所市场挂牌交易且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，按最近交

易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易且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，按最近交易日所采用的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(5) 在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) 基金管理人如采用本项第(1) - (6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，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) 首次发行未上市的权证，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) 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进行估值。

(4) 基金管理人如采用本项第(1) - (3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (3)项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 4、股票指数期货合约估值方法：

(1) 股票指数期货合约以结算价格进行估值。

(2) 基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、其他有价值证券等资产按国家有关规定进行估值。

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。以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以约定形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管

理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、半年和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 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登记结算机构或代销机构或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差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。

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产生的差错，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，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，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失时，基金管理人和基金托管人拒绝进行赔偿时，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有责任的当事人进行追索，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方式处理差错。

### 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，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金资

产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，基金托管人在履行正常的复核程序后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4)前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2、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；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(八) 基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(九) 特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项、权证估值方法的第(4)项、股票指数期货合约估值方法的第(2)项进行估值或复核时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

**十六、基金的收益分配**

(一) 收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；
- 3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 5、本基金收益分配采取现金方式；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### (二) 基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

### (三) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### (四) 收益分配方案的确定与公告

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后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

### (五) 收益分配中发生的费用

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。

## 十七、基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；



- 3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 9、基金财产拨划支付的银行费用；
- 10、证券账户开户费用；
- 11、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

### (三) 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，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = EX \text{ 年管理费率} + \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 0.50\%$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = EX \text{ 年托管费率} + \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.10\%$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的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。其中，基金合同生效 前的许可使用固定费不列入基金费用。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率 计提。计算方法如下：

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

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，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 元的，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。

如果指数使用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使用费。

基金管理人可根据指数许可使用协议和为基金份额持有人的利益，对计提方 式进行合理变更并公告。

基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、上述（一）中 4 到 11 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协 议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （四）与基金销售有关的费用

#### 1、认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时可按照下表费率收取认 购

费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时，可参照下表费率结构收取一定的佣金。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。

认购份额	认购费率
M<50 万份	1.00%
50 万份<M<100 万份	0.50%
M ≥ 100 万份	1000 元/笔

## 2、申购与赎回的对价、费用

申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人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。

申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前通知深圳证券交易所及登记结算机构，并在深圳证券交易所及基金管理人网站公告。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

### (五) 不列入基金费用的项目

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，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、信息披露费等费用不列入基金费用。

(六) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

### (七) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十八、基金的会计与审计

### (一)基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二)基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 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 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 十九、基金的信息披露

(一)本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。

### (二)信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息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，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三)本基金信息披露义务人在承诺公开披露的基金信息时，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四)本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五)公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、招募说明书、基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1) 招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 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。

(2) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及投资人重大利益的事项的法律文件。

(3) 托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

#### 2、基金份额发售公告

基金管理人应当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基金管理人网站上。

#### 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

#### 4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在指定报刊及基金管理人网站上公告。

#### 5、基金资产净值、基金份额净值公告

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，通过基金管理人网站、申购赎回代理机构以及其他媒介，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基金管理人网站上。

#### 6、申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过网站以及其他媒介公告当日的申购赎回清单。

#### 7、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### 8、基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应至少提前两个工作日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

#### 9、基金定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

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基金管理人网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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基金管理人网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上。

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基金管理人网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 10、临时报告

本基金发生重大事件，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。

前款所称重大事件，是指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下列事件：

- (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) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 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；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (10) 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%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 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；
- (14) 重大关联交易事项；



- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 基金变更、增加或减少销售代理机构；
- (20) 基金更换登记结算机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 变更标的指数；
- (24) 本基金暂停接受申购、赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；
- (26) 基金推出新业务或服务；
- (27) 基金份额持有人大会的决议；
- (28) 基金份额暂停、恢复、终止上市交易；
- (29) 中国证监会规定的其他事项。

#### 11、澄清公告

在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。

#### 12、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，应当依法报中国证监会核准或者备案，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 30 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，基金管理人、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。

13、中国证监会规定的其他信息。

#### (六)信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并以双方认可的方式向基金管理人出具确认意见。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### (七)信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

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。

## 二十、风险揭示

### (一) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### (1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

(2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

(3) 利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，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，从而影响基金资产的保值增值。

(5) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

(一) 本基金特有的风险

1、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。

2、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、投资人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。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投 资

组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(5) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### 4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司计算基金份额参考净值（IOPV），并由深圳证券交易所交易时间发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

#### 7、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市等原因，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险

#### 8、投资人申购失败的风险

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代。因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

#### 9、投资人赎回失败的风险

在投资人提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### 10、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

#### 11、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。

(2) 登记结算机构可能调整结算制度，如对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

#### (三)

指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，导致基金资产损失。

#### (四) 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资人大额赎回

的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### （五）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### （六）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记结算机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### （七）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （八）其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

#### （九）风险声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

### 二 H、基金的业务规则

基金份额持有人应遵守基金托管人、基金管理人及其代销机构和登记结算机构的相关交易及业务规则。

## 二十二、基金合同的变更、终止与清算

### (一)基金合同的变更

1. 按照法律法规或基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。

2. 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变更后公布经修订的基金合同，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、相关证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当对基金合同进行修改；
- (5) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
- (6) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (7) 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；
- (8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

情  
形。

### (二)基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
3. 基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。



基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### (三)基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算小组

(1) 基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2. 基金财产清算程序

(1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；

(2) 对基金财产进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估价和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将基金清算结果报告中国证监会；

(8) 公布基金清算报告；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3. 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

#### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

5. 基金财产清算的期限为 12 个月。若因流动性等非基金管理人和基金托管人原因造成基金财产清算不能按时完成，基金管理人和基金托管人不承担责任。法律法规另有规定的，按其规定执行。

#### 6. 基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 7. 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。

### 二十三、基金合同的内容摘要

#### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

##### 1、基金管理人的权利、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的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的规定，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人的利益；

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结算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的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融券；

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) 根据法律法规、基金合同、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、收益分配等方面的业务规则；

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；

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、勤勉尽责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开放式基金份额认购价格、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；计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，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) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购或赎回之基金份额的投资人应收对价；

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) 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人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资人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前提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，将已募集的认购款项、股票连同认购款项的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。

## 2、基金托管人的权利、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人的利益；

4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、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和基金份额申购、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) 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。

### 3、基金份额持有人的权利、义务

(1) 基金投资人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，基金投资人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。

(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

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) 依法转让或者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、基金销售机构损害其合法权益的行为依 法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(3) 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) 认真阅读并遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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股票、应付申购对价和赎回对价及基金合同 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定；
- 8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- 9) 遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
- 10) 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

1、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。

2、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基金份额持有人大会。

### 3、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) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；

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，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；

12) 对基金合同当事人权利、义务产生重大不利影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，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、相关证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当对基金合同进行修改；

5) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

6) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

7) 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；

8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

#### 4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有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。

(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，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基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

#### 5、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)基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

6) 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；

7) 表决方式；

8) 会务常设联系人姓名、电话；

9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由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、书面表达意见的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,不影响计票和表决结果。

## 6、基金份额持有人出席会议的方式

### (1)会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会或法律法规及监管机构允许的其他开会方式。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

3)通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

### (2)召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

a) 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,全

部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

b) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a) 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；

b) 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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

c) 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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

d) 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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符；

e) 会议通知公布前报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

3) 对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 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、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。法律法规另有规定的除外。

5) 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日前 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。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）多数选举产生一名代表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。

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) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 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。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

(4) 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) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。



4) 计票过程应由公证机关予以公证。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

10、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

(2) 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。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定。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

(4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### (三) 基金合同变更和终止的事由、程序

#### 1、基金合同的变更

(1) 按照法律法规或基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。

(2) 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

和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，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、相关证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当对基金合同进行修改；
- 5) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
- 6) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 7) 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；
- 8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- (3) 基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

## 3、基金财产的清算

### (1)基金财产清算小组

1) 基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估价和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 8) 公布基金清算报告；
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1) — 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(5) 基金财产清算的期限为 12 个月。若因流动性等非基金管理人和基金托管人原因造成基金财产清算不能按时完成，基金管理人和基金托管人不承担责任。法律法规另有规定的，按其规定执行。

(6) 基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

(7) 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。

(四) 争议解决方式

对于因基金合同产生或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(五) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

**二十四、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：景顺长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 办公地址：

深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 邮政编码：518048 法

定代表人：杨光裕 成立日期：2003 年 6 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】76 号 组织

形式：有限责任公司 注册资本：1.3 亿元人民币 存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## 2、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998] 23 号 注册资本：32，479，411.7 万元人民币 存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币 有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金 托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院 银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行

监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及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。

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，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

(2) 本基金从事股票指数期货投资时，遵循相关法律法规的规定：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%；本基金在任何交易日日终，持有的买入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；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金所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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金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%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入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；

(4) 本基金参与股票发行申购,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;

(5) 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;

(6) 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。

(7) 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%。

(8) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

(9) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

(10) 法律法规规定或基金合同约定的其他限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述 1-3 项以及 6-8 项规定的投资比例的,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 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。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

上述投资组合限制条款中,若属法律法规的强制性规定,则当法律法规或监管部门变更或取消上述限制,在履行适当程序后,本基金投资可相应变更或取消上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

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,对本协议第十五

条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

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，如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。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，并及时向基金托管人报备。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。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选



择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(3) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

6、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复核和监督。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

(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股票行为的紧急通知》、《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) 在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4) 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件

(如有)：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

(5) 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。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。

(6) 基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

(7) 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或

者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

8、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

9、基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

10、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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）基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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。

2、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、本协议及其他有关规定时，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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定的期限内及时改正。在上述规定期限内，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。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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、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，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

(7) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人 托管基金财产。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行 开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，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，基金 管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账 户，网下股票认购所募集的股票应划入以基金托管人和本基金联名方式开立的 证券账户下，基金托管人在收到资金和股票当日出具确认文件。同时在规定时 间内，基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资， 出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师 签字方为有效。

(3) 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、股票解冻等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3、基金资金账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账 户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴 由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款、支付或收取现金差额、支付或收 取现金替代、支付或收取现金替代退补款，均需通过本基金的资金账户进行。

(3) 基金托管资金帐户的开立和使用，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任何其他银行账户；亦不 得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专 用账户办理基金资产的支付。

## 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，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责任公司开设证券账户。

(2) 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或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。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(5) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、投资人申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的结算通知和基金管理人的指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代和现金差额的结算。

#### 6、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定及基金管理人指令，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场和资金的清算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 7、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定

办理。

#### 8、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

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由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 9、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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### (五) 基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算及复核程序

##### (1) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每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) 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

#### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### (1) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

##### (2) 估值方法

1) 股票估值方法：

a) 上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

b) 未上市股票的估值。

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值

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，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

c) 基金管理人如采用本项第 a) -b) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第

a) -b) 小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

d) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2) 债券估值方法：

a) 在证券交易所市场挂牌交易且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，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

b) 在证券交易所市场挂牌交易且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，按最近交易日所采用的净价估值；如果估值



日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

c) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

d) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

e) 在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。

f) 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。

g) 基金管理人如采用本项第 a) — f) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 a) — f) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

h) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3) 权证估值方法：

a) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，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) 首次发行未上市的权证，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) 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进行估值。

d) 基金管理人如采用本项第 a) -c) 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理

人认为按本项第 a) – c)项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

e) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4) 股票指数期货合约估值方法：

a) 股票指数期货合约以结算价格进行估值。

b) 基金管理人如采用本项第 a)小项规定的方法对基金资产进行估值，均 应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 a)小 项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

c) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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。以约定的方法、程序和相关法律法 规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

### (3)特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 c)项、债券估值方法的第 g)项、权证估值方法的第 d)项、股票指数期货合约估值方法的第 2)项进行 估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

### 3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内 (含第 3 位)发生差错时，视为基 金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超 过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国 证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告、通报 基金托管人并报中国 证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责 处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付， 基金管理人按差错情形，有权

向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金额，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在履行正常复核程序后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

(2) 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；

(3) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### 7、基金财务报表与报告的编制和复核

##### (1)财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并予以公告。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

##### (2)报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托

管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

8、基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记结算机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 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。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。

仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### (八) 托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，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

(1) 基金合同终止；

(2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

##### 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组

1) 基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算

小组可以依法进行必要的民事活动。

(2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估价和变现；
- 4) 编制清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 8) 公布基金清算报告；
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1) — 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(5) 基金财产清算的期限为 12 个月。若因流动性等非基金管理人和基金托管人原因造成基金财产清算不能按时完成，基金管理人和基金托管人不承担责任。法律法规另有规定的，按其规定执行。

(6) 基金财产清算的公告

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 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计

师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

(7) 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。

**二十五、对基金份额持有人的服务**

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改以下服务项目：

(一) 基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金交易记录；

2、每年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向留有完整信息的所有持有本基金份额或本年度内发生本基金交易的投资者以书面形式寄送对账单。每季度结束后 15 个工作日内，基金管理人向留有完整信息的本季度内发生本基金交易的投资者以书面形式寄送对账单。每月度结束后 10 个工作日内向定制电子对账单服务且持有本基金份额或本月内发生本基金交易并留有完整信息的投资者以电子邮件或手机短信形式提供对账单。

我公司于 2013 年 11 月 15 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于调整基金对账单寄送服务形式的公告》，自 2013 年 11 月 15 日起，投资者首次开立本公司基金账户并申购本公司旗下基金的，如申购基金的招募说明书中约定以书面形式寄送对账单的，此书面形式将确认为电子邮件形式，本公司将在每期（季度、年度）结束后的 10 个工作日内向投资者发送基金账户对账单或其他重要资料。

因提供的个人信息（包括但不限于姓名、电子邮件地址、邮寄地址、邮编等）不详、错误、变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的，请及时到原基金销售网点或本公司网站办理联系方式变更手续。详询 400-8888-606，或通过本公司网站“在线客服”咨询。

(二) 网络在线服务



基金管理人利用其网站 ([www.igwfmc.com](http://www.igwfmc.com)) 定期或不定期为投资者提供 基金管理人信息、基金产品信息、账户查询、投资策略分析报告、热点问答等 服务。投资者可以登陆该网站修改基金查询密码。

对于直销个人客户，基金管理人还将提供网上查询服务。

### (三) 客户服务中心 (Call Center) 电话服务

投资者想要了解交易情况、基金账户余额、基金产品与服务信息或进行投 诉等，可拨打基金管理人客户服务电话：400 8888 606 (免长途费)。

客户服务中心的人工坐席服务时间为每周一至周五 (法定节假日及因此导 致的证券交易所休市日除外) 9:00-17:00。

### (四) 客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、基金管理人网站留言栏目、自动语 音留言栏目、客户服务中心人工热线、书信、电子邮件等六种不同的渠道对基 金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

基金管理人承诺在工作日收到的投诉，将在下一个工作日内作出回应，在 非工作日收到的投诉，将顺延至下一个工作日当日或者次日回复。对于不能及 时解决的投诉，基金管理人就投诉处理进度向投诉人作出定期更新。

(五) 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述 方式联系本基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说 明书。

## 二十六、其他应披露事项

2016 年 10 月 25 日发布 [《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年第 3 季度报告》](#)

2016 年 8 月 27 日发布 [《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年半年度报告》](#) 及 [《摘要》](#)

2016 年 7 月 21 日发布 [《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年第 2 季度报告》](#)

2016 年 6 月 21 日发布 [《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年第 1 号更新招募说明书》](#) 及 [《摘要》](#)

## 二十七、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

(一) 中国证监会准予景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资

基金募集注册的文件

- (二) 景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三) 证券投资基金登记结算服务协议
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (八) 中国证监会要求的其他文件

景顺长城基金管理有限公司  
二〇一六年十二月二十二日