泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

更新招募说明书

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

重要提示

本基金募集申请已于2011年8月24日获中国证监会证监许可『2011』1338号文核准，基金合同于2011年12月1日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、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。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年6月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日，财务数据未经审计。

目 录

一、绪言 2
二、释义 3
三、基金管理人 7
四、基金托管人 17
五、相关服务机构 18
六、基金份额的分类与净值的计算 39
七、基金的募集 43
八、基金合同的生效 43
九、泰达500A份额与泰达500B份额的上市交易 44
十、基金份额的申购与赎回 45
十一、基金份额的配对转换 57
十二、基金的投资 58
十三、基金的业绩 71
十四、基金的财产 72
十五、基金资产的估值 73
十六、基金收益与分配 78
十七、基金费用与税收 79
十八、基金份额的折算 82
十九、泰达500A份额与泰达500B份额的终止运作 91
二十、基金的会计和审计 93
二十一、基金的信息披露 94
二十二、风险揭示 99
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 103
二十四、基金合同的内容摘要 105
二十五、基金托管协议的内容摘要 120
二十六、对基金份额持有人的服务 131
二十七、其他应披露事项 132
二十八、招募说明书存放及查阅方式 137
二十九、备查文件 137

一、绪言

本招募说明书依据《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》）等有关法律法规以及《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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。基金投资者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。基金投资者欲了解本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

《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
基金管理人或本基金管理人：	指泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人或本基金托管人：	指中国银行股份有限公司
基金合同或本基金合同：	指《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《泰达宏利中证500 指数分级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
招募说明书：	指《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后一日
基金份额发售公告：	指《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金份额发售公告》
法律法规：	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、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
《基金法》：	指2012年12月28日经中华人民共和国第十一届全国人民常务委员会第三十次会议通过的自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订
《销售办法》：	指2013年2月17日由中国证监会第二十八次主席办公会议通过的自2013年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订

《信息披露办法》：	指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》：	指2014年7月7日由中国证监会公布并于2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（包括配套《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》）及颁布机关不时做出的修订
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监督管理机构：	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
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
个人投资者：	指年满18周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人
机构投资者：	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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
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》规定的条件，经中国证监会批准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基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资人：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
基金份额持有人：	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
基金销售业务：	指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构：	指直销机构和代销机构

直销机构：	指泰达宏利基金管理有限公司
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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
基金销售网点：	指直销机构的直销中心、网上直销及代销机构的代销网点
注册登记业务：	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记结算、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构：	指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为泰达宏利基金管理有限公司或接受泰达宏利基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
基金账户：	指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户：	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户。
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
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
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
存续期：	指基金合同生效后合法存续的期限。本基金的存续期间为不定期
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T日：	指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期
T+n日：	指自T日起第n个工作日（不包含T日）

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
交易时间：	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
《业务规则》	指《泰达宏利基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人、注册登记机构、销售机构和投资人共同遵守
认购：	指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为
申购：	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
赎回：	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
基金转换：	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
转托管：	指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作
定期定额投资计划：	指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
巨额赎回：	指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%
元：	指人民币元
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

基金资产总值：	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值：	指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
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
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
不可抗力：	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

成立日期：2002年6月6日

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

法定代表人：弓劲梅

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-66577808

信息披露联系人：陈沛

注册资本：一亿八千万元人民币

股权结构：北方国际信托股份有限公司：51％；宏利资产管理（香港）有限公司：49％

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于2002年6月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至目前，公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金（LOF）、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金（LOF）、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金在内的三十多只证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

弓劲梅女士，董事长。拥有天津南开大学经济学博士学位。曾担任天津信托有限责任公司研究员，天弘基金管理有限公司高级研究员，天津泰达投资控股有限公司高级项目经理，天津市泰达国际控股（集团）有限公司融资与风险管理部副部长。现任天津市泰达国际控股（集团）有限公司资产管理部部长。

刘建先生，董事。先后毕业于中国政法大学、天津财经学院，获法学学士、

经济学硕士学位。1988 年至 2001 年任中国建设银行股份有限公司金融机构部副处长；2001 年至 2003 年任中信银行股份有限公司资金清算中心负责人；2003 年至 2014 年任中银国际证券有限责任公司机构业务部董事总经理。2014 年 10 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，2015 年 4 月任公司副总经理，2015 年 8 月起任公司总经理。

杨雪屏女士，董事。拥有天津大学工科学士和中国人民大学新闻学硕士学位。1995 年至 2003 年曾在天津青年报社、经济观察报社、滨海时报社等报社担任记者及编辑；2003 年至 2012 年就职于天津泰达投资控股有限公司办公室秘书科；自 2012 年至今就职于天津市泰达国际控股（集团）有限公司，曾担任资产管理部高级项目经理，现任综合办公室副主任。

孙泉先生，董事。拥有天津南开大学经济学学士和经济学硕士学位及美国芝加哥罗斯福大学工商管理硕士学位。1988 年任职于天津开发区信托投资公司，负责信贷和外汇管理工作；1989 年任职于天津开发区管理委员会政策研究室，负责区域发展、国企改革、对外合作政策的研究和制定工作；1997 年任职于天津经济技术开发区总公司企划部，负责企业发展战略研究和计划经营管理工作；2001 年任职于天津泰达投资控股公司资产管理部，负责泰达控股重组并购、资源整合、上市筹备和金融类、实业类企业的经营管理工作。现任天津泰达投资控股公司资产管理部经理，渤海产业基金投资管理公司、恒安标准人寿保险公司和天津钢管集团股份有限公司董事等职。

何达德先生，董事。毕业于英国伦敦城市大学，取得精算学荣誉理学士学位。现为宏利行政副总裁及宏利人寿保险（国际）有限公司首席行政总监，宏利资产管理（香港）有限公司首席行政总监，负责宏利于香港的全线业务，包括个人保险、雇员福利及财富管理等业务。同时何先生分别为宏利人寿保险（国际）有限公司及宏利资产管理（香港）有限公司之董事。现为澳大利亚精算学会及美国精算学会会员，在寿险及退休顾问工作方面拥有三十多年的丰富经验，其间担任多个领导层要职。

任赛华女士，董事。毕业于加拿大滑铁卢大学（University of Waterloo），获得数学学士学位，加拿大安大略省会计师公会之特许会计师。任女士于 2007 年加盟宏利资产，曾任首席行政事务总监，现担任宏利资产亚洲区零售经销部

主管。早年任女士曾任职于亚洲和加拿大的著名国际投资银行、会计事务所及省级退休金委员会，监管托管业务的销售及担任全球基金服务客户关系管理、新业务发展及会计等高级职务。2013 年 6 月至 2015 年 4 月担任泰达宏利基金管理有限公司监事。

杜汶高先生，董事。毕业于美国卡内基梅隆大学，持有数学及管理科学理学士学位，现为宏利资产管理(亚洲)总裁兼亚洲区主管及宏利资产管理(香港)有限公司董事，掌管亚洲及日本的投资事务，专责管理宏利于区内不断壮大的资产，并确保公司的投资业务符合监管规定。出任现职前，杜先生掌管宏利于亚洲区(香港除外)的投资事务。2001 年至 2004 年，负责波士顿领导机构息差产品的开发工作。杜先生于 2001 年加入宏利，之前任职于一家环球评级机构，曾获派驻纽约、伦敦及悉尼担任杠杆融资及资产担保证券等不同部门的主管，拥有二十多年的资本市场经验。

汪丁丁先生，独立董事，毕业于北京师范学院数学系，中国科学院数学力学部理学硕士学位，1990 年获夏威夷大学经济学博士学位。1984 年至 1998 年先后担任中国科学院系统科学研究所助理研究员、美国东西方中心人口研究所访问学者、博士后研究员、香港大学经济与金融学院助理教授、德国杜依斯堡大学经济系客座教授、北京大学中国经济研究中心副教授及美国夏威夷大学经济系访问教授。目前担任北京大学及浙江大学教授，自 2007 年至今，担任东北财经大学“社会与行为”跨学科教育中心学术委员会主席兼主任。

周小明先生，独立董事。毕业于浙江大学法学院，持有中国政法大学法学硕士学位、民商法法学博士学位。1990 年起先后任职于浙江大学、中国人民银行非银行金融机构监管司、君泽君律师事务所、安信信托投资股份有限公司。曾担任全国人大常委会财经委员会《中华人民共和国信托法》、《基金法》起草小组成员、安信信托投资股份有限公司总裁。目前担任中国人民大学信托与基金研究所所长、君泽君律师事务所合伙人、清华大学法学院联合法律硕士导师、中国信托业协会培训与资格办公室副主任、《中国信托业发展报告》主编。

杜英华女士，独立董事，任期始于 2014 年 6 月 20 日。毕业于南开大学法律系，获得法学学士和法学硕士学位。1992 年 10 月，与其他合伙人共同发起设立天津津华律师事务所，现任该律所副主任，正高级律师，具有 22 年法律实

务经验。同时担任天津第五届律师协会理事、天津第六届律师协会监事。

何自力先生，独立董事，1982年毕业于南开大学，经济学博士。1975年至1978年，于宁夏国营农场和工厂务农和做工：1982年至1985年，于宁夏自治区党务从事教学和科研工作；1988年至今任职于南开大学，历任经济学系系主任、经济学院副院长，担任教授、博士生导师；兼任中国经济发展研究会副会长和秘书长、天津经济学会副会长；2002年1月至7月在美国加利福尼亚大学伯克利分校作访问学者。

2、监事会成员

许宁先生，监事长。毕业于南开大学，经济学硕士。1991年至2008年任职于天津市劳动和社会保障局；2008年加入天津市泰达国际控股（集团）有限公司，担任党委委员、董事会秘书、综合办公室主任。

陈景涛先生，监事。拥有澳大利亚麦考瑞大学商学学士、麦考瑞大学应用金融学硕士和南澳大学金融学博士学位。1998年先后就职于渣打银行、巴克莱资本、Baron Asset Management；2005年加入宏利资产，曾担任固定收益高级投资经理，现担任北亚投资负责人。

王泉先生，职工监事。管理学学士、经济学硕士。2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司工作至今，历任基金运营部基金会计、基金运营部副总经理、基金运营部总经理、运营副总监兼基金运营部总经理，自2014年10月起担任运营总监。

邓艺颖女士，职工监事。金融学硕士，2004年5月至2005年4月就职于中国工商银行广东省分行公司业务部；2005年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、固定收益部研究员、研究部总监业务助理兼研究员、研究部副总监，现任投资副总监兼研究部总监；具备11年基金从业经验，11年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

3、总经理及其他高级管理人员

弓劲梅女士，董事长。简历同上。

刘建先生，总经理。简历同上。

傅国庆先生，副总经理。毕业于南开大学和美国罗斯福大学，获文学学士和工商管理硕士学位，北京大学国家发展研究院EMBA。1993年至2006年就职于北方国际信托股份有限公司，从事信托业务管理工作，期间曾任办公室主任、

研发部经理、信托业务总部总经理、董事会秘书、以及公司副总经理。2006年9月起任泰达宏利基金管理有限公司财务总监；2007年1月起任公司副总经理兼财务总监。

王彦杰先生，副总经理。毕业于台湾中山大学和淡江大学，获企业管理学士和财务金融硕士学位。1998年8月至2001年4月，先后在国际证券、日商大和证券、元大投信担任股票分析师；2001年5 月至 2008年2月，任保德信投信股票投资主管；2008年2月至2008年8月，就职于复华投信香港资产管理公司，担任执行长；2008年8月至 2015年10月，就职于宏利资产管理有限公司，担任台湾地区投资主管；2015 年 10 月加盟泰达宏利基金管理有限公司担任投资总监，2015 年 12 月起任泰达宏利基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张萍女士，督察长。毕业于中国人民大学和中国科学院，管理学和理学双硕士。先后任职于中信公司、毕马威国际会计师事务所等公司，从事财务管理和管理咨询工作。2002年起在嘉实基金管理有限公司工作，任监察稽核部副总监。2005年10月起任泰达宏利基金管理有限公司风险管理部总监。2006年11月起任泰达宏利基金管理有限公司督察长。

4、 基金经理

杨超先生，数学与金融计算硕士；2010年5月加入建信基金管理有限公司，从事金融工程等工作，先后担任投资管理部助理研究员、初级研究员、基金经理助理等职务；2014年6月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任基金经理助理，现任基金经理；2014年10月13日起担任泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金经理；2014年10月13日起担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理；2015年11月20日起担任泰达宏利绝对收益策略定期开放混合发起式证券投资基金基金经理。具备 6 年证券基金从业经验，6 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

本基金历任基金经理：王咏辉先生，自2011年12月起至2012年8月管理本基金。刘欣先生，自2012年8月14日起至2016年3月16日管理本基金。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会由公司总经理刘建、投资总监王彦杰、研究部门负责人邓

艺颖、金融工程部门负责人戴洁、固定收益部门负责人卓若伟、基金经理兼首席策略分析师庄腾飞组成。督察长张萍列席会议。

投资决策委员会根据决策事项，可分为固定收益类事项、权益类事项、其它事项。

1）固定收益类事项由刘建、王彦杰、卓若伟表决。

2）权益类事项由刘建、王彦杰、邓艺颖、戴洁、庄腾飞表决。

3）其它事项由全体成员参与表决。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、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；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风

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资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）承销证券；

（4）将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

（5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资；

（6）依照法律、行政法规的有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、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、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（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、对倒、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。

5、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则

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。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

（2）独立性原则：设立独立的监察稽核与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

（3）相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，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。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

（4）风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

（5）监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、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、控制和规避，尽可能地减少损失；

（7）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，使员工明确其职责所在，控制风险。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60％以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2016年03月31日，中国银行已托管446只证券投资基金，其中境内

基金416只，QDII基金30只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2015年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

1）泰达宏利基金管理有限公司直销中心

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心南楼三层

联系人：于贺

联系电话：010-66577619、010-66577617

客服信箱：irm@mfcteda.com

客服电话：400-698-8888

传真：010-66577760/61

公司网站：http://www.mfcteda.com

2）泰达宏利基金网上直销系统

交易系统网址：https://etrade.mfcteda.com/etrading/

目前网上直销支持的银行卡和第三方支付渠道：农业银行卡、建设银行卡、中国银行卡、兴业银行卡、民生银行卡、招商银行卡、中信银行卡、光大银行卡、浦发银行卡、交通银行卡、广发银行卡、汇付天下“天天盈”、快钱支付账户。

客户服务电话：400-698-8888或010-66555662

客户服务信箱：irm@mfcteda.com

泰达宏利微信公众账号：mfcteda_BJ，支持民生银行卡、招商银行卡和汇付天下“天天盈”账户、快钱支付账户。

2、场外代销机构

1）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

银行网站：www.boc.cn

2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

银行网站：www.ccb.com

3）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：北京市东城区建国门内大街69号

客服电话：95599

银行网站：www.abchina.com

4）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

银行网址：www.bankcomm.com

5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

公司网站：www.cmbchina.com

6）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

7) 平安银行股份有限公司

注册地址： 深圳市深南东路5047号

办公地址：深圳市深南东路5047号

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

公司网站：bank.pingan.com

8）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

网址：www.bankofshanghai.com

9）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

10） 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

11） 东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路21号

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：卢国锋

电话：0769－22119061

传真：0769－22117730

联系人：陈幸

客服电话：400-119-6228

公司网址：www.dongguanbank.cn

12） 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路294号

办公地址： 宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人： 陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人： 胡技勋

客户服务热线：95574

公司网站： www.nbcb.com.cn

13）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11层

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021-68865680

公司网站：www.xcsc.com

14）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

传真：022-28451892

电子邮箱：hutt@bhzq.com

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

15）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

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

客服电话：4008-888-888

电话：010-66568450

联系人：宋明

公司网站：www.chinastock.com.cn

16）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

客服电话：95575或致电各地营业网点

联系人：黄岚

公司网站：www.gf.com.cn

17）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

客服电话：400-888-8108

传真：010－65182261

公司网站： www.csc108.com

18）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

客服电话： 95521

联系人：芮敏祺

公司网站：www.gtja.com

19）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼

全国免费业务咨询电话：95511

传真：0755-82400862

网址：www.PINGAN.com

20）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

客服电话：0755-83199511

公司网站：www.csco.com.cn

21）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系电话：021-33389888

客服电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

22）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

23）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层

法定代表人：许刚

客服电话：400-620-8888

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

公司网站：www.bocichina.com

24）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：吴万善

客户服务电话： 95597

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

公司网站：www.htsc.com.cn

25）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

26）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525 400-888-8788 101-089-98

传真：021-22169134

公司网址：www.ebscn.com

27）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

客户服务电话：400-698-9898

公司网址：www.xsdzq.cn

28）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565，400-888-8111

公司网址：www.newone.com.cn

29）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层

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：刘阳

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

30）南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭8号

办公地址：江苏省南京市大钟亭8号

法定代表人：张华东

联系人：潘月

联系电话：025-52310569

客户服务电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

31）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

联系电话：0591-38162212

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

32）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客服电话：95553或400-8888-001

联系电话：021－23219000

公司网站：www.htsec.com

33）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

法定代表人：邱三发

客服电话：020-961303

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

34）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

传真：0591-87383610

联系人：张宗锐

公司网站：www.hfzq.com.cn

35）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

联系电话：0755－82130833

传真：0755-82133952

公司网站：www.guosen.com.cn

36）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼

法定代表人：陆涛

客户服务电话：400-888-8228

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网站：www.jyzq.cn

37）德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

客服电话：400-888-8128

传真：021-68767981

联系人：朱磊

公司网站：www.tebon.com.cn

38）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：王连志

客服电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

网址：www.essence.com.cn

39）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

公司网络地址：www.longone.com.cn

客服电话：95531，400-888-8588

40）国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

41）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼（410005）

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

开放式基金业务传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

42）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

43）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579或400-888-8999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

44）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层

法定代表人：雷杰

客户服务热线：95571

网址：www.foundersc.com

45）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

公司网址：www.mszq.com

客服热线：400-619-8888

46）国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

客服电话：95310

公司网址： www.gjzq.com.cn

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

47）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

公司网址：www.citics.com

客服热线：95558

48）西藏同信证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄24号楼

法定代表人：贾绍君

公司网址：www.xzsec.com

客服热线：400-881-1177

49）西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

公司网址：www.westsecu.com

客服热线：95582

50）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层，深圳市华侨城深南大道9010号

法定代表人：吴永良

公司网址：www.zszq.com

客服热线：400-102-2011

51）九州证券股份有限公司

注册地址：西宁市城中区西关大街11号

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼

法定代表人：曲国辉

公司网址：www.jzsec.com

客服热线：400-654-3218

52）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

公司网址：www.jhzq.com.cn

客服热线：400-666-2288

53）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

公司网址：www.wlzq.com.cn

客服热线：400-888-8133

54）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼20层

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

公司网址：www.citicssd.com

客服热线：95548

55）红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

公司网址：www.hongtastock.com

客服热线：400-871-8880

56）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层

办公地址： 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼

法定代表人：陈林

公司网址： www.cnhbstock.com

客服热线： 400-820-9898

57）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦5楼

法定代表人：余维佳

公司网址：www.swsc.com.cn

客服热线：400-809-6096

58）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

公司网址：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

59)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号8楼

法定代表人： 汪静波

公司网址：www.noah-fund.com

客服热线：400-821-5399

60)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路1号物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

客服热线：4006-788-887

61)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

公司网址：www.ehowbuy.com

客服热线：400-700-9665

62)杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：杭州市西湖区天目山路266号黄龙时代广场B座支付宝

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-076-6123

公司网址：http://www.fund123.cn/

63)上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C-9楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

64)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：刘潇

电话：021-021-20691942

传真：021-20691861

客服电话：400-820-2899

公司网址： www.erichfund.com

65)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835817

传真号码：021-20835885

全国统一客服热线：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

66)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

全国统一客服热线：400-888-6661

公司网址：www.myfund.com

67)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

68)一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

客户服务热线: 400-001-1566

公司网址: www.yilucaifu.com

69)上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：冯修敏

客户服务热线: 400-820-2819

公司网址: https://tty.chinapnr.com

70)上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

客户服务热线: 400-821-9031

公司网址: www.lufunds.com

71)大泰金石投资管理有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

地址：上海市浦东新区峨山璐505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

客户服务热线: 400-928-2266

公司网址: http://www.dtfortune.com

72)浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址: 浙江省杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

地址：浙江省杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

客户服务热线: 400-068-0058

公司网址: http:// www.jincheng-fund.com

73)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座17层

法定代表人：杨懿

客户服务热线: 400-166-1188

公司网址: http://money.jrj.com.cn

74)上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

客户服务热线: 400-046-6788

公司网址: http://www.66money.com

3、场内发售机构

本基金办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深交所会员。

具有中国证监会认定的基金代销业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务；具有中国证监会认定的基金代销业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务（具体办理场所以《基金开放申购、赎回公告》为准）。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限公司

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：严峰

电话：（0755）25946013

传真：（0755）25987122

（三）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：梁丽金、刘佳

（四）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：上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人：赵柏基

经办注册会计师：单峰、庞伊君

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：庞伊君

六、基金份额的分类与净值的计算

（一）基金份额的类别

本基金的基金份额包括泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“泰达中证500份额”）、泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之500A份额（简称“泰达500A”）与泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之500B份额（简称“泰达500B”）。其中，泰达500A、泰达500B的基金份额配比始终保持4：6 的比率不变。

（二）基金份额的分离与分拆规则

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，投资者场外

认购的全部份额将确认为泰达中证 500 份额；投资者场内认购的全部份额将按照 4：6 的比率自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即泰达 500A 份额和泰达 500B 份额。两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，泰达中证 500 份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。泰达 500A 份额和泰达 500B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

投资者可在场内申购和赎回泰达中证 500 份额，投资者可选择将其场内申购的泰达中证 500 份额按 4:6 的比例分拆成泰达 500A 份额和泰达 500B 份额。投资者可按 4:6 的配比将其持有的泰达 500A 份额和泰达 500B 份额申请合并为泰达中证 500 份额后赎回。

投资者可在场外申购和赎回泰达中证 500 份额。场外申购的泰达中证 500 份额不进行分拆，但《基金合同》另有规定的除外。投资者可将其持有的场外泰达中证 500 份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成泰达 500A 份额和泰达 500B 份额后上市交易。投资者可按 4：6 的配比将其持有的泰达 500A 份额和泰达 500B 份额合并为泰达中证 500 份额后赎回。

（三）泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值计算规则

由于场内泰达中证 500 份额分离出的泰达 500A 份额和泰达 500B 份额具有不同的参考净值计算规则，所以使泰达 500A 份额和泰达 500B 份额具有不同的风险收益特征。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按《基金合同》约定的净值计算规则对泰达 500A 份额和泰达 500B 份额分别进行参考净值计算，本基金净资产优先确保泰达 500A 份额的本金及泰达 500A 份额累计约定日应得收益；本基金在优先确保泰达 500A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为泰达 500B 份额的净资产。

在本基金的存续期内，泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值计算规

则如下：

1、 泰达 500A 份额约定的年基准收益率为“1 年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%”， 1年期同期银行定期存款利率以基金成立日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准，并按每年 1月1日和7月1日的中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率对泰达 500A 份额的年基准收益率进行调整。年基准收益均以1.00元为基准进行计算；

2、 存续期内，本基金每个工作日对泰达500A份额和泰达500B份额进行参考净值计算。在进行泰达500A份额和泰达500B份额各自的参考净值计算时，本基金净资产优先确保泰达500A份额的本金及泰达500A份额累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为泰达500B份额的净资产。泰达500A份额累计约定日应得收益按泰达500A份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日泰达500A份额应计收益的天数确定；

3、 每10份泰达中证500份额所代表的4份泰达500A份额和6份泰达500B份额分别计入泰达500A份额总额和泰达500B份额总额进行参考净值计算，并将分别按分离后的泰达500A份额和泰达500B份额的份额数享有获得份额折算的权利，每10份泰达中证500份额所代表的资产净值等于4份泰达500A份额和6份泰达500B份额的参考净值之和；

4、 若在本基金存续的完整会计年度内未发生《基金合同》约定的份额折算事项，泰达500A份额应计收益的天数按该会计年度年初至计算日的实际天数计算；在本基金的基金合同生效日所在会计年度，或者在某一会计年度内本基金依据《基金合同》之规定进行不定期份额折算的，泰达500A 份额在参考净值计算日应计收益的天数应按照自基金合同生效日、或者最近一次该会计年度内份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证泰达500A份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，泰达500A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

（四）本基金基金份额的计算

本基金作为分级基金，按照泰达中证500份额的净值计算规则以及泰达500A份额和泰达500B份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算各基金份额T日的单位净值和参考净值。

1、 泰达中证 500 份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日泰达中证 500 份额的基金份额净值NAV_{500}=T 日闭市后本基金的基金资产净值/T 日本基金的基金份额总数

2、 泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值计算

$$NAV_{500A} = (1+R)^{\frac{t}{N}}$$

$$NAV_{500B} = (10 \times | NAV_{500} - 4 \times NAV_{500A}) / 6$$

设基金份额净值的计算日为 T 日，T = 1,2,3,4,5…N，N 为当年实际天数

NAV_{500}：泰达中证 500 份额单位净值

NAV_{500A}： 泰达 500A 份额单位参考净值

NAV_{500B}：泰达 500B 份额单位参考净值

R ： 泰达 500A 份额约定的年基准收益率

t ： 基金合同生效日至 T 日；自年初至 T 日；自最近一次会计年度内份额折算日至 T 日。

泰达中证500份额、泰达500A份额和泰达500B份额的基金份额参考净值计算，均保留到小数点后面4位，小数点后面第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

T日的基金净值在当天闭市后计算，并于T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可适当延迟计算或公告。

七、基金的募集

（一）本基金依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已获中国证监会证监许可『2011』1338号文核准。

（二）基金类型、运作方式及存续期

本基金类型：股票型

本基金运作方式：契约型开放式

本基金存续期：不定期

（三）上市交易所

深圳证券交易所

（四）基金募集情况

经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的有效认购户数为4,152户，净销售金额为人民币1,435,113,080.87元，折合基金份额1,435,113,080.87份；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计人民币354,684.61元，折合354,684.61份基金份额归基金份额持有人所有，合计募集份额为1,435,467,765.48份。上述资金已于2011年12月1日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

八、基金合同的生效

（一）基金合同备案的条件

基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理基金验

资和备案手续：

1、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；

2、基金份额持有人的人数不少于200人。

（二）基金的验资和备案

基金募集期限届满，具备上述条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同生效

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于2012年12月1日正式生效。自《基金合同》生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（四）基金存续期内基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当及时向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。

九、泰达500A份额与泰达500B份额的上市交易

（一） 上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请泰达500A份额和泰达500B份额上市交易。

（二） 上市交易的地点

本基金的泰达500A份额和泰达500B份额的上市地点为深圳证券交易所。

（三） 上市交易的时间

上市交易的时间：2011年12月22日。

（四） 上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《上市规则》、《深圳证券

交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1）泰达中证500份额所分离的泰达500A份额与泰达500B份额以不同的交易代码上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的净值；

2）泰达500A份额与泰达500B份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

3）泰达500A份额与泰达500B份额买入申报数量为100 份或其整数倍；

4)泰达500A份额与泰达500B份额申报价格最小变动单位为0.001 元人民币；

5）泰达500A份额与泰达500B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

（五） 上市交易的费用

泰达500A和泰达500B上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（六） 上市交易的行情揭示

泰达500A份额与泰达500B份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额参考净值。

（七） 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

泰达500A份额与泰达500B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

（八） 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，《基金合同》相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十、基金份额的申购与赎回

本基金的泰达500A份额、泰达500B份额不接受投资者的申购与赎回；在本基金《基金合同》生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对泰达中证500

份额进行日常的申购与赎回。

（一）申购和赎回场所

投资者办理泰达中证 500 份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人的直销机构及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点参见以上“五、相关服务机构”中“（一）基金份额发售机构”。

投资者办理泰达中证 500 份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理泰达中证 500 份额场内申购、赎回业务。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。基金投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

（二）申购与赎回的账户

投资者办理泰达中证 500 份额申购、赎回应使用经本基金注册登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜见相关业务公告）。

（三）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照相关法律法规的有关规定在指定媒体上公告。

2、申购、赎回开放日及业务办理时间

（1）开放日及业务办理时间

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（本基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间另行公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理泰达中证 500 份

额的申购、赎回。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其泰达中证500份额申购、赎回的价格为下一开放日泰达中证500份额申购、赎回的价格。

（2）申购赎回的开始时间

本基金已于2011年12月22日起开放日常申购、赎回。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

（四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日泰达中证500份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回泰达中证500份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、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，但最迟应在新的原则实施前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请

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

基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）为基金投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

销售机构对申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申购申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给基金投资者，由此产生的利息等损失由基金投资者自行承担。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定支付赎回款项，并通过注册登记机构及其相关销售机构在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

（六）申购和赎回的限制

1、通过直销中心申购本基金，单个基金账户单笔首次申购最低金额为 10 万元（含申购费），追加申购最低金额为 1000 元（含申购费），已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。投资者通过场内、场外代销机构申购泰达中证 500 份额的，单个基金账户单笔最低申购金额为 1000 元（含申购费）；代销机构调整申购金额下限的，以最新公告为准；

通过本公司网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为 10 元（含申购费），单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

2、申请赎回基金的份额

投资者可将全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回的基金份额不得低于 100 份。

3、基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 100 份的，基金管理人有权一次将持有人在该交易账户

保留的剩余基金份额全部赎回。

4、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对申购金额、赎回份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，基金管理人进行前述调整必须依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告。

（七）申购和赎回的数额和价格

1、基金申购份额的计算

净申购金额＝申购金额 / （1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额 / 申购当日基金单位净值

基金份额份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资者投资 5 万元申购泰达中证 500 份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝申购金额 / （1＋申购费率）＝50,000 / （1+1.2％）＝49,407.11 元

申购费用＝申购金额－净申购金额＝50,000－49,407.11＝592.89 元

申购份额＝净申购金额 / 申购当日基金份额净值＝49,407.11 / 1.016＝48,629.05 份

即：投资者投资 5 万元申购基金，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则可得到 48,629.05 份基金份额。

2、基金赎回金额的计算

赎回金额＝赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例如：某投资者赎回基金 1 万份基金份额，持有期小于 1 年，对应的赎回

费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，则可得到的净赎回金额为：

赎回金额= 10000×1.016=10160元

赎回费=10160×0.5%=50.80元

净赎回金额=10160-50.80=10109.20元

即：投资者赎回基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元，则其可得到的净赎回金额为10109.20元。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费后，以申请当日基金份额净值为基准计算，有效份额单位为份。基金份额份数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

6、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

7、申购费用由投资者承担，并应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。申购费率具体如下表所示：

	申购金额（M，含申购费）	费率
场外申购费率	M<50万	1.20%
	50万≤M<250万	1.00%
	250万≤M<500万	0.60%
	500万≤M<1000万	0.40%
	M≥1000万	每笔1000元

场内申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率

8、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

赎回费率具体如下表所示：

	连续持有期限（日历日）	费率
场外赎回费率	1天 ～365天	0.5％
	366天（含）～730天	0.25％
	731天（含）以上	0
场内赎回费率	本基金的场内赎回费率为固定赎回费率0.5%	

9、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或调整收费方式。申购、赎回费率或收费方式如发生变更，基金管理人应依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日在指定媒体和基金管理人网站上公告。

10、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定范围、特定地域、特定时间、特定交易方式等的基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

11、对特定交易方式（如：网上直销）的费率，基金管理人将另行公告。

12、自 2013 年 6 月 14 日起，基金管理人面向申购本基金的养老金客户实施特定申购费率，详情请参阅本基金管理人于 2013 年 6 月 13 日发布于中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站的《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金实施特定申购费率的公告》。

13、根据 2015 年 4 月 18 日基金管理人发布《泰达宏利基金管理有限公司关于网上直销平台调整旗下开放式基金申购金额下限的公告》本公司自 2015 年 4 月 20 日起投资者通过本公司官方网上直销和微信公众平台（微信号：mfcteda_BJ）首次最低申请金额统一调整为 10 元；追加申购金额为单笔 10 元。

（八）申购和赎回的注册登记

1．泰达中证 500 份额的份额采用分系统登记的原则。场外申购的泰达中证 500 份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的泰达中证 500 份额登记在证券登记结算系统持有人深圳证券账户下。

2．登记在注册登记系统和证券登记结算系统中的泰达中证 500 份额可通过基金销售机构申请赎回，但不可通过上市交易卖出。

3．基金投资者在 T 日申购基金成功后，正常情况下，注册登记机构在 T＋1 日为基金投资者增加权益并办理注册登记手续，基金投资者自 T＋2 日起有权赎回该部分基金份额。

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

5．基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

（九）巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受泰达中证 500 份额全额赎回或部分延期赎回。

1、接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10％的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

3、当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体予以上公告。

4、暂停接受和延缓支付：泰达中证500份额连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种会指定媒体上公告。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（4）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

（4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。除非发生巨额赎回，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的泰达中证500份额净值。

（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，第2个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个工作日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个工作日的基金份额净值。

（十二）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供泰达中证500份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

（十三）基金份额的登记、转托管和其他相关业务

1、非交易过户

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的

基金会或社会团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

2、基金份额的登记

1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的泰达中证500份额基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的泰达中证500份额或上市交易买入的泰达500A、泰达500B基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

2）登记在证券登记结算系统中的泰达中证500份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的泰达500A份额和泰达500B份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按4：6比例申请合并为泰达中证500份额后再申请场内赎回。

3）登记在注册登记系统中的泰达中证500基金份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人进行申请按4：6比例分离为泰达500A份额和泰达500B份额后在深圳证券交易所上市交易。

3、系统内转托管

1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理泰达中证500份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有泰达中证500份额的系统内转托管。

3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理泰达中证500份额场内赎回或泰达500A份额和泰达500B份额上市交易的会员单位(交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4、跨系统转托管

1)跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的泰达中证500份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2)泰达中证500份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

5、基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

6、基金的质押

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

7、如法律法规、注册登记机构或深圳证券交易所的有关规则发生变化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

（十四）定期定额投资计划

定期定额申购业务是指投资者可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请，约定每期扣款时间、扣款金额，由指定的销售于每次约定扣款日在投资者指定的资金账户自动完成扣款，并提交基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金已于2011月12月22日起开始接受定期定额投资业务。具体实施方法详见相关公告。

根据2015年4月18日基金管理人发布《泰达宏利基金管理有限公司关于网上直销平台调整旗下开放式基金申购金额下限的公告》，本公司自2015年4月20日起，投资者通过本公司官方网上直销和微信公众平台（微信号：mfcteda_BJ）定期定额申购单笔最低金额为10元。

（十五）其他特殊交易

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人还可办理除上述业务以外的其他特殊交易业务。

（十六）如法律法规、注册登记机构或深圳证券交易所的有关规则发生变

化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

十一、基金份额的配对转换

本基金合同生效后，在泰达500A份额和泰达500B份额的存续期内，本基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

（一）份额配对转换是指本基金的泰达中证500份额与泰达500A份额、泰达500B份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

1.分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每十份泰达中证500份额的场内份额申请转换成四份泰达500A份额与六份泰达500B份额的行为。

2.合并

合并指基金份额持有人将其持有的每四份泰达500A份额与六份泰达500B份额申请转换成十份泰达中证500份额的场内份额的行为。

（二）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见《招募说明书》或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

（三）份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自泰达500A份额、泰达500B份额上市交易后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前2日在至少一家指定媒体公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（四）份额配对转换的原则

1.份额配对转换以份额申请。

2.申请分拆为泰达500A份额和泰达500B份额的泰达中证500份额的场内份额必须是10的整数倍。

3.申请合并为泰达中证500份额的泰达500A份额与泰达500B份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且满足4：6的配比关系。

4.泰达中证500份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为泰达中证500份额的场内份额后方可进行。

5.份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记结算机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前2日在至少一家指定媒体公告。

（五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

（六）暂停份额配对转换的情形

1.深圳证券交易所、基金注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2.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。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

（七）份额配对转换的业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

十二、基金的投资

（一）投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证500指数，力争获取与标的指

数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

（二）投资理念

采用被动式投资方法，在最小化基金投资组合与标的指数之间跟踪误差与偏离度同时，实现与标的指数的长期同步增长，为投资者提供一个简单便利的获取中小企业长期成长价值的投资工具。

（三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成分股、新股、固定收益产品、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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）占基金资产的比例为85%－100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，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

本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成分股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以实现对跟踪误差的有效控制。

1、投资组合的构建

本基金采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

2、组合的调整

（1）定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调

整。

（2）不定期调整

①当成份股实施增发、配送或使股本发生变动等行为时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪。

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

3、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

4、股指期货投资策略

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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

（五）投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金

财产的决策依据。

2、投资决策程序

本基金的投资管理程序由研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,降低交易成本，避免重大风险的发生。开放式指数基金跟踪误差的来源包括对受限成份股的替代投资、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理并搭配使用其他合理的方法（如买入非成份股等）进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。

1）研究：基金经理、研究人员依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、组合优化和股票的替代、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

2）投资决策：投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议和基金管理人的研究报告及相关研究成果，每日进行基金投资管理的日常决策。

3)组合构建：基金经理根据标的指数，结合研究报告，原则上以复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的技术和方法，利用股票的替代或其他数量化交易方法来降低买入成本和冲击成本，控制投资风险。

4)交易执行：交易部负责具体的交易执行并利用有效的日内数量化交易方法来降低冲击成本，同时履行一线监控的职责。

5)投资绩效评估：风险管理与基金评估部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告和建议。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

6)组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、量化分析、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估

的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中列示。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：95％×中证 500 指数收益率+5％×1 年期定期存款利率（税后）

如果中证 500 指数被停止编制及发布,或中证 500 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在中国证监会指定的媒体上公告。

（七）风险收益特征

本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰达 500A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰达 500B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

(4) 基金投资组合中投资中证500指数成份股的资产不低于股票资产净值的 90%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

(5) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合

①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%；

②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。

③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%；

④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；

⑤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%；

⑥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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基

金资产净值的40%；

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(8)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

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

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

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

(13)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；

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（九）投资组合比例调整

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。因证券期货市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

（十）基金管理人代表基金行使股东及债权人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及债权人权利，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。

（十一）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

（十二）基金投资组合报告（未经审计）

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年6月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2016年3月31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	50,109,361.24	93.16
	其中：股票	50,109,361.24	93.16
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	3,420,925.63	6.36

	付金合计		
8	其他资产	260,805.02	0.48
9	合计	53,791,091.89	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	141,918.00	0.27
B	采矿业	1,239,196.90	2.33
C	制造业	27,069,315.96	50.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,396,306.00	2.62
E	建筑业	244,923.00	0.46
F	批发和零售业	3,468,112.38	6.52
G	交通运输、仓储和邮政业	1,564,174.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,613,335.40	6.79
J	金融业	391,735.40	0.74
K	房地产业	3,416,495.20	6.42
L	租赁和商务服务业	184,760.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,320,755.00	2.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	591,953.00	1.11
S	综合	816,208.00	1.53
	合计	45,459,188.24	85.40

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,866,873.00	3.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,116.00	0.09
E	建筑业	96,924.00	0.18
F	批发和零售业	191,524.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,310,598.00	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	209,772.00	0.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	687,006.00	1.29
L	租赁和商务服务业	241,360.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,650,173.00	8.74

2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	600094	大名城	122,700	923,931.00	1.74
2	600704	物产中大	68,900	919,815.00	1.73
3	000667	美好集团	227,000	910,270.00	1.71
4	600458	时代新材	62,900	903,244.00	1.70
5	000758	中色股份	67,000	903,160.00	1.70
6	600292	中电远达	61,200	896,580.00	1.68
7	600517	置信电气	93,800	884,534.00	1.66
8	300088	长信科技	79,300	872,300.00	1.64
9	002396	星网锐捷	50,900	865,300.00	1.63
10	600765	中航重机	55,100	863,968.00	1.62

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

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	601872	招商轮船	136,100	698,193.00	1.31
2	002357	富临运业	43,900	612,405.00	1.15
3	000890	法 尔 胜	67,200	542,976.00	1.02
4	600683	京投银泰	35,500	330,150.00	0.62
5	002433	太安堂	31,700	323,657.00	0.61

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名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名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名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

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

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

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金没有投资国债期货。

11.投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2)基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,723.84
2	应收证券清算款	84,975.39
3	应收股利	-
4	应收利息	638.62
5	应收申购款	157,467.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	260,805.02

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(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。

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000890	法 尔 胜	542,976.00	1.02	重大事项

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2011年12月1日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

（一）历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
本基金合同生效起至2011年12月31日	-2.00%	0.74%	-13.78%	1.60%	11.78%	-0.86%
2012年1月1日至2012年12月31日	-1.40%	1.42%	0.56%	1.46%	-1.96%	-0.04%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.55%	1.37%	16.29%	1.37%	-1.74%	0.00%
2014年1月1日至2014年12月31日	32.25%	1.15%	37.06%	1.18%	-4.81%	-0.03%
2015年1月1日至2015年12月31日	57.06%	2.97%	41.39%	2.68%	15.67%	0.29%
2016年1月1日至2016年3月31日	-13.86%	3.28%	-18.18%	3.08%	4.32%	0.20%
本基金合同生效起至2016年3月31日	98.05%	1.96%	59.87%	1.87%	38.18%	0.09%

（二）泰达中证500基金自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图（2011年12月1日-2016年3月31日）

本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

十四、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

（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金额。

（三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管及处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十五、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的公允价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的泰达中证500份额净值，是计算泰达中证500份额申购与赎回价格以及计算泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额参考净值的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（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）上市流通股票的估值

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以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）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以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。

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的情况下，按成本估值。

（3）有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

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

（2）交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

（4）首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（5）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

（6）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，

未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（7）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。

3、权证估值：

（1） 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

（2） 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值。

4、股指期货的估值

股指期货合约，以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，采用最近交易日结算价估值。

5、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述1-6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，如果基金管理人有充足的理由认为按上述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的基础上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，按国家最新规定进行估值。

（五）基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照泰达中证 500 份额净值计算规则以及泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日泰达中证 500 份额净值、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的基金份额参考净值：

1、 泰达中证 500 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日泰达中证 500 份额的基金份额净值＝T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额的份额数之和。

2、 泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_{500A} = (1+R)^{\frac{t}{N}}$$

$$NAV_{500B} = (100 * NAV_{500} - 4 * NAV_{500A}) / 6$$

设基金份额参考净值的计算日为 T 日，T = 1,2,3,4,5…N，N 为当年实际天数

NAV_{500}： 泰达中证 500 份额单位净值

NAV_{500A}： 泰达 500A 份额单位参考净值

NAV_{500B}： 泰达 500B 份额单位参考净值

R ：泰达 500A 份额约定的年基准收益率

t ：基金合同生效日至T日；自年初至T日；自最近一次会计年度内份额折算日至T日。

泰达中证500份额净值、泰达500A份额和泰达500B份额的基金份额参考净值计算，均保留到小数点后面4位，小数点后面第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

T日的基金净值在当天闭市后计算，并于T+1日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可适当延迟计算或公告。

（六）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，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（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营业时；

2、因不可抗力或基金管理人、基金托管人不可控制的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、中国证监会认定的其他情形。

（八）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。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，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另

有规定的，从其规定。

（九）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后4位（含第4位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（十）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第7项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十六、基金收益与分配

（一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净利润

基金净利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。基金期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配方案

在存续期内，本基金（包括泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额）不进行收益分配。

十七、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后的指数许可使用费；

4、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）；

5、基金上市初费和上市月费

6、基金合同生效以后的信息披露费用；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

9、基金资产的资金汇划费用；

10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.0%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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每日计提指数许可使用费。其中，基金合同生效前的指数许可使用费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用从基金财产中列支；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

H＝E×0.02%÷当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人与指数许可方约定了每季度（包括基金成立当季）指数许可使用费人民币伍万元（5 万元）(即不足人民币 5 万元时按照人民币 5 万元收取)的收取下限，则该下限超出当季累计指数使用费的部分（即：每季度指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费）由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。基金合同生效后的指数许可使用费按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十八、基金份额的折算

（一） 定期折算

在泰达500A份额、泰达中证500份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

1、基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

2、 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的泰达500A份额、泰达中证500份额。

3、基金份额折算频率

每年折算一次。

4、基金份额折算方式

泰达500A份额和泰达500B份额按照基金合同第四部分规定的参考净值计

算规则进行参考净值计算，对泰达 500A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 10 份泰达中证 500 份额将按 4 份泰达 500A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的份额配比保持 4：6 的比例。对于泰达 500A 份额期末的约定应得收益，即泰达 500A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额参考净值超出 1.0000 元部分，将折算为泰达中证 500 份额的场内份额分配给泰达 500A 份额持有人。泰达中证 500 份额持有人持有的每 10 份泰达中证 500 份额将按 4 份泰达 500A 份额获得新增泰达中证 500 份额的分配。持有场外泰达中证 500 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外泰达中证 500 份额的分配；持有场内泰达中证 500 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内泰达中证 500 份额的分配。经过上述份额折算，泰达 500A 份额和泰达中证 500 份额的基金份额净值和参考净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对泰达中证 500 份额和泰达 500A 份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行泰达中证 500 份额当年应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

（1）泰达中证 500 份额

$$NAV_{500}^{后} = NAV_{500}^{前} - 0.4 \times (NAV_{500A}^{前} - 1.0000)$$

泰达中证 500 份额持有人新增的泰达中证 500 份额 =

$$0.4 \times NUM_{500}^{前} \times (NAV_{500A}^{前} - 1.0000) / NAV_{500}^{后}$$

其中：

$NAV_{500}^{前}$：定期份额折算前泰达中证500份额的基金份额净值，下同

$NAV_{500}^{后}$：定期份额折算后泰达中证500份额的基金份额净值，下同

$NAV_{500A}^{前}$：定期份额折算前泰达500A份额的基金份额参考净值，下同

$NUM_{500}^{前}$：定期份额折算前泰达中证500份额的份额数，下同

持有泰达中证 500 份额的场外份额的持有人将按上述折算方式获得新增泰达中证 500 份额的场外份额的分配；持有泰达中证 500 份额的场内份额的持有人将按上述折算方式获得新增泰达中证 500 份额的场内份额的分配。

泰达中证 500 份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；泰达中证 500 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

（2）泰达 500A 份额

定期份额折算后泰达 500A 份额的基金份额参考净值=1.0000 元

定期份额折算后泰达 500A 份额的份额数＝定期份额折算前泰达 500A 份额的份额数

泰达 500A 份额持有人新增的泰达中证 500 份额的份额数=

$$[NUM_{500A}^{前}\times(NAV_{500A}^{前}-1.0000)]/NAV_{500}^{后}$$

其中：

$NAV_{500}^{后}$：定期份额折算后泰达中证 500 份额净值

$NUM_{500A}^{前}$：定期份额折算前泰达 500A 份额的份额数

泰达 500A 份额折算成泰达中证 500 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

（3）泰达 500B 份额

定期份额折算不改变泰达 500B 份额参考净值及其份额数。

（4）折算后泰达中证 500 份额的总份额数

折算后泰达中证 500 份额的总份额数＝定期份额折算前泰达中证 500 份额的份额数＋泰达中证500份额持有人新增的泰达中证500份额数＋泰达500A份额持有人新增的泰达中证500份额数。

5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停泰达500A份额与泰达500B份额的上市交易和泰达中证500份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

7、特殊情形的处理

若在定期份额折算日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，将按照不定期份额折算的规则进行份额折算。

（二）不定期折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当泰达中证500份额净值大于或等于2.0000元；当泰达500B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元。

（1） 当泰达中证500份额的基金份额净值大于或等于2.0000元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

1）基金份额折算基准日

泰达中证500份额的基金份额净值大于或等于2.0000元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额。

3）基金份额折算频率

不定期。

4）基金份额折算方式

当泰达中证500份额的基金份额净值大于或等于2.0000元后，本基金将分别对泰达500A份额、泰达500B份额和泰达中证500份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保泰达500A份额和泰达500B份额的比例为4：6，份额折算后泰达500A份额、泰达500B份额和泰达中证500份额的基金份额净值均调整为1.0000元。基金份额折算日折算前泰达中证500份额净值、泰达500A份额和泰达500B份额的基金份额参考净值超出1.0000元的部分均将折算为泰达中证500份额分别分配给泰达中证500份额、泰达500A份额和泰达500B份额的持有人。

当泰达中证 500 份额的份额净值大于或等于 2.0000 元后，泰达 500A 份额、泰达 500B 份额、泰达中证 500 份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

① 泰达 500A 份额

份额折算原则：

a\ 份额折算前泰达 500A 份额的份额数与份额折算后泰达 500A 份额的份额数相等；

b\ 泰达 500A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1 元以上的参考净值部分全部折算为场内泰达中证 500 份额。

$$NUM_{500A}^{后} = NUM_{500A}^{前}$$

泰达 500A 份额持有人新增的泰达中证 500 份额的份额数

$$= \frac{NUM_{500A}^{前} \times (NAV_{500A}^{前} - 1.0000)}{1.0000}$$

其中：

$NUM_{500A}^{前}$：份额折算前泰达 500A 份额的份额数

$NUM_{500A}^{后}$：份额折算后泰达 500A 份额的份额数

$NAV_{500A}^{前}$：份额折算前泰达 500A 份额的单位参考净值

泰达 500A 份额折算成泰达中证 500 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

② 泰达 500B 份额

份额折算原则：

a\份额折算后泰达 500B 份额与泰达 500A 份额的份额数保持 6：4 配比；

b\份额折算前泰达 500B 份额的资产与份额折算后泰达 500B 份额的资产及因此折算新增的场内泰达中证 500 份额的资产之和相等；

c\ 份额折算前泰达 500B 份额的持有人在份额折算后将持有泰达 500B 份额与新增场内泰达中证 500。

$$NUM_{500B}^{后} = NUM_{500B}^{前}$$

泰达 500B 份额持有人新增的场内泰达中证 500 份额的份额数

$= NUM_{500B}^{前} \times (NAV_{500B}^{前} - 1.0000)/1.0000$

其中：

$NUM_{500B}^{前}$：份额折算前泰达 500B 份额的份额数

$NUM_{500B}^{后}$：份额折算后泰达 500B 份额的份额数

$NAV_{500B}^{前}$：份额折算前泰达 500B 份额的单位参考净值

泰达 500B 份额折算成泰达中证 500 份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

③ 泰达中证 500 份额

份额折算原则：

场外泰达中证 500 持有人份额折算后获得新增场外泰达中证 500，场内泰达中证 500 持有人份额折算后获得新增场内泰达中证 500。

$$NUM_{500}^{后} = [NUM_{500}^{前} \times (NAV_{500}^{前} - 1.0000)]/1.0000$$

其中：

$NAV_{500}^{前}$： 折算前泰达中证 500 份额单位净值

$NUM_{500}^{前}$：折算前泰达中证 500 份额的份额数

$NUM_{500}^{后}$：折算后新增的泰达中证 500 份额的份额数

④ 折算后泰达中证 500 份额的总份额数

折算后泰达中证 500 份额的总份额数=不定期份额折算前泰达中证 500 份额的份额数+泰达中证 500 份额持有人新增的泰达中证 500 份额数+泰达 500A 份额持有人新增的泰达中证 500 份额数+泰达 500B 份额持有人新增的泰达中证 500 份额数

（2） 当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

1）基金份额折算基准日

泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的泰达 500A 份额、泰达 500B 份额、泰达中证 500 份额。

3）基金份额折算频率

不定期。

4）基金份额折算方式

当泰达 500B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元后，本基金将分别对泰达 500A 份额、泰达 500B 份额和泰达中证 500 份额进行份额

折算，份额折算后本基金将确保泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的比例为 4：6，份额折算后泰达中证 500 份额净值、泰达 500A 份额和泰达 500B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。

当泰达 500B 份额参考净值小于或等于 0.2500 元后，泰达 500A 份额、泰达 500B 份额、泰达中证 500 份额三类份额将按照如下公式进行份额折算。

① 泰达 500B 份额

份额折算原则：

份额折算前泰达 500B 份额的资产与份额折算后泰达 500B 份额的资产相等。

$$NUM_{500B}^{后} = \frac{NUM_{500B}^{前} \times NAV_{500B}^{前}}{1.0000}$$ 其中：

$NUM_{500B}^{后}$：折算后泰达 500B 份额的份额数

$NUM_{500B}^{前}$：折算前泰达 500B 份额的份额数

$NAV_{500B}^{前}$：折算前泰达 500B 份额的单位参考净值

② 泰达 500A 份额

份额折算原则：

a\份额折算前后泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的份额数始终保持 4：6 配比；

b\份额折算前泰达 500A 份额的资产与份额折算后泰达 500A 份额的资产及新增场内泰达中证 500 份额的资产之和相等；

c\份额折算前泰达 500A 的持有人在份额折算后将持有泰达 500A 份额与新增场内泰达中证 500 份额。

$$NUM_{500A}^{后} = \frac{2}{3} \times NUM_{500B}^{后}$$

泰达 500A 份额持有人新增的泰达 500A 份额数：

$$= \left(NUM_{500A}^{前} \times NAV_{500A}^{前} - NUM_{500A}^{后} \times 1.0000 \right) / 1.0000$$

其中：

$NUM_{500A}^{后}$：折算后泰达 500A 份额的份额数

$NUM_{500B}^{后}$：折算后泰达 500B 份额的份额数

$NAV_{500A}^{前}$：折算前泰达 500A 份额单位参考净值

$NAV_{500B}^{后}$：折算前泰达 500A 份额的份额数

③ 泰达中证 500 份额：

份额折算原则：

份额折算前泰达中证 500 份额的资产与份额折算后泰达中证 500 份额的资产相等。

$$NUM_{500}^{后} = \frac{NAV_{500}^{前} \times NUM_{500}^{前}}{1.0000}$$

其中：

$NUM_{500}^{后}$：折算后泰达中证 500 份额的份额数

$NAV_{500}^{前}$：折算前泰达中证 500 份额的单位净值

$NUM_{500}^{前}$：折算前泰达中证 500 份额的份额数

泰达中证 500 份额的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；泰达中证 500 份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

④ 折算后泰达中证 500 份额的总份额数：

折算后泰达中证 500 份额的总份额数=不定期份额折算后泰达中证 500 份额的份额数+泰达 500A 份额持有人新增的泰达中证 500 份额数

5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的上市交易和泰达中证 500 份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

十九、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的终止运作

（一）经基金份额持有人大会决议通过，泰达 500A 份额与泰达 500B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的泰达中证 500 份额、泰达

500A 份额与泰达 500B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

（二）泰达 500A 份额与泰达 500B 份额终止运作后的份额折算

泰达 500A 份额与泰达 500B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，泰达 500A 份额、泰达 500B 份额将全部折算成场内泰达中证 500 份额。

1、份额折算基准日

泰达 500A 份额与泰达 500B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

2、份额折算方式

运作期到期日泰达 500A 份额与泰达 500B 份额按届时各自份额净值与泰达中证 500 份额净值之比折算为泰达中证 500 份额。

3、份额折算公式

份额折算后泰达 500A 份额与泰达 500B 份额单位净值等于折算前泰达中证 500 份额单位资产净值。

泰达 500A 份额折算成泰达中证 500 份额的份额数= $\frac{NUM_{500A}^{前} \times NAV_{500A}^{前}}{NAV_{500}^{前}}$

泰达 500B 份额折算成泰达中证 500 份额的份额数= $\frac{NUM_{500B}^{前} \times NAV_{500B}^{前}}{NAV_{500}^{前}}$

其中：

$NUM_{500A}^{前}$：泰达 500A 份额折算前份额数；

$NUM_{500B}^{前}$：泰达 500B 份额折算前份额数；

$NAV_{500A}^{前}$：泰达 500A 份额折算前单位资产净值；

$NAV_{500B}^{前}$：泰达 500B 份额折算前单位资产净值；

$NAV_{500}^{前}$：泰达中证 500 份额折算前单位资产净值。

泰达 500A 份额、泰达 500B 份额折算成的泰达中证 500 份额数，场内份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

4、份额折算后的基金运作

泰达 500A 份额与泰达 500B 份额全部折算为场内泰达中证 500 份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

5、份额折算的公告

泰达 500A 份额与泰达 500B 份额进行份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

二十、基金的会计和审计

(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，经通报基金托管人，并

报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告。

二十一、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，并保证基金投资者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媒体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者决策的全部事项，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。本基金合同生效后，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网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体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基金投资者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、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发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体和基金管理人网站上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在获得本基金合同生效确认文件的次日在指定媒体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媒体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

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次

日，通过网站、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媒体和基金管理人网站上。

6、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网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体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媒体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。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

7、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)基金更换注册登记机构；

(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）本基金发生巨额赎回并延期支付；

(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)中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

在本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。

9、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。

10、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、赎回价格、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，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

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媒体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媒体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。

基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

(八)暂停或延迟信息披露的情形

1.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；

2.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

3.法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

二十二、风险揭示

本基金存在的主要风险有：

（一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为

通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

（三）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

（四）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

（五）指数基金特有风险

本基金为股票型指数基金，存在的风险包括跟踪偏离风险和标的指数风险。

跟踪误差风险：本基金管理人将尽责进行严格风险控制，并控制基金投资组合与标的指数之间的跟踪误差及偏离度，但由于法律法规及其他限制，本基金不能投资于部分成分股；此外，在基金的日常运作中由于受到运作费用、交易成本、日常申购赎回以及市场流动性影响，不可避免的会产生与标的指数之间的跟踪偏离。

标的指数风险：标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

（六）基金运作风险

1、上市交易风险

泰达500A份额与泰达500B份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期

间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖泰达500A份额与泰达 500B 份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致泰达 500A 份额与泰达500B份额产生流动性风险。

2、杠杆机制的风险

本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，泰达500A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；泰达500B份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于泰达500B份额内含杠杆机制的设计，泰达500B份额参考净值的变动幅度将大于泰达中证500份额净值和泰达500A份额参考净值的变动幅度，即泰达500B份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

3、折、溢价交易风险

泰达500A份额与泰达500B份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将泰达500A份额和泰达500B份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

4、风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在泰达中证500份额净值大于或等于2.000元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原泰达500B份额持有人将会获得一定比例的泰达中证500份额，因此原泰达500B份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在泰达500B份额参考净值小于或等于0.250元后，本基金将进行不定期份额折算。原泰达500A份额持有人将会获得一定比例的泰达中证500份额，因此，原泰达500A份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于对泰达500A基金份额在会计年度初，把约定收益折算为场内泰达中证500份额的设计，使原泰达500A份额持有人将会获得一定比例的泰达中证500份额，因此，原泰达500A份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

5、份额折算风险

（1）在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），整数位以后部分采取截位法，余额计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

（2）份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买泰达 500A 份额或泰达500B份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买泰达500A份额或泰达500B份额，在其参与份额折算后，则折算新增的泰达中证500份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意,投资者可以选择在份额折算前将泰达500A份额或泰达500B份额卖出，或者将新增的泰达中证500份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

6、份额配对转换业务中存在的风险

《基金合同》生效后，在泰达中证500份额、泰达500A份额和泰达500B份额的存续期内，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理泰达中证500份额与泰达500A份额、泰达500B份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变泰达500A份额和泰达500B份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

7、基金的收益分配

在存续期内，本基金（包括泰达中证500份额、泰达500A份额和泰达500B份额）将不进行收益分配。在每个会计年度年的第一个工作日，基金管理人将根据《基金合同》的约定对本基金泰达中证500份额和泰达500A份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或

赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

（七）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)基金合同的变更

1.按照法律法规或本基金合同的规定，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)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更或增加收费方式；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；

(5)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；

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二)本基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后本基金合同终止：

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。

(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。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止情形发生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。

6.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。

二十四、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一)基金管理人

1、基金管理人简况

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层

邮政编码：100033

法定代表人：弓劲梅

成立时间：2002 年6 月6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002]37号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿捌仟万元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（3）依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（4）在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

（6）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

（7）自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（8）选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（10）依法召集基金份额持有人大会；

（11）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；

（12）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

（13）法律法规规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

（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财产分别管理，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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）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；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

（15）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（16）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；

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（19）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；

（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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人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托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）建立并保存基金份额持有人名册；

（24）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；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）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；

（27）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（28）法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

(二)基金托管人

1、基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

存续期间：持续经营

2、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

（1）安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5)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和独立；

（6）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；

（7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

（9）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应予以保密，不得向他人泄露；

（10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（11）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；

（12）保存基金份额持有人名册；

（13）复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）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

和赎回款项；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

（18）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

（19）因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规和本基金合同另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(三)基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

泰达500A份额、泰达500B份额、泰达中证500份额持有人持有的每一份基金份额按《基金合同》约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。但本基金依据基金合同第四部分之规定对泰达500A份额和泰达500B份额进行参考净值计算时，持有泰达中证500份额的基金份额持有人将被视作其同时持有按4：6的比例分离的泰达500A份额和泰达500B份额，并将分别按分离后的泰达500A份额和泰达500B份额数享有并行使份额折算的权利。

2、基金份额持有人的权利

（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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

（3）在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；

（4）不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

（5）执行基金份额持有人大会的决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（7）遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

（8）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（四）本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

二、基金份额持有人大会

（一）本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

（二）有以下情形之一时，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自份额10%以上（含10%，下同）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）提议，应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、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；

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、变更基金类别；

6、变更基金投资目标、范围或策略；

7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

8、本基金与其他基金合并；

9、终止泰达500A份额与泰达500B份额的运作；

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

11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率；

2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率及收费方式、调低赎回费率；

3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4、对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实质性变化；

5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6、标的指数更换名称或指数公司调整指数编制方法；

7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）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。

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、单独或合计持有泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自基金份额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、单独或合计持有泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自基金份额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，单独或合计持有泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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。

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

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1、会议召开的时间、地点、方式；

2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

3、代理投票授权委托书送达时间和地点；

4、会务常设联系人姓名、电话；

5、权益登记日；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（六）开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；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。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证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、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%）；

4、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其他代表，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；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

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应保持不变。

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。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计持有权益登记日泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自份额10%（含10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前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至少30天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日30天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日30天前公告。

（3）对于基金管理人、基金托关人以及基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、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

持有人大会上进行解释和说明。

b、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做出决定。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做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合计持有权益登记日泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额各自份额10%（含10%）以上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，或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。法律法规另有规定除外。

（5）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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

（八）表决

1、泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

（2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的泰达中证500份额、泰达500A份额、泰达500B份额的基金份额持有人所持表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会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，大会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）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

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票人在监督人（如果基金管理人为召集人，基金托管人为监督人；如果基金托管人

为召集人，基金管理人为监督人）派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，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。

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、基金托管人均有法律约束力。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当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

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。

（十一）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、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

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、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

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）、（2）、（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席位保证金等，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。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

二十五、基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：泰达宏利基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层

办公地址：北京市西城区金融大街7 号英蓝国际金融中心南楼三层

邮政编码：100033

法定代表人：弓劲梅

成立日期：2002年6月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2002]37号

组织形式：有限责任公司

注册资本：一亿八千万元人民币

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督：

(1)基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

(4) 基金投资组合中投资中证500指数成份股的资产不低于股票资产净值的 90%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

(5) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合

①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%；

②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％。

③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%；

④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；

⑤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%；

⑥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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40％；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10％；

(8)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20％；

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10％；

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

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

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

（13）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；

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。基金

托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。因证券期货市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

3、为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先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，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定的基金投资的其他方面进行监督。

（二）基金托管人应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。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

四、基金财产的保管

（一）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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，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、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

（三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。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，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

（五）基金证券账户和资金账户的开设和管理

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、本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。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、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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

（六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设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债券和资金的清算。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。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后4位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予

以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除本协议和基金合同另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（二）基金会计核算

1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方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。

2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现

存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，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》生效后每六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10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，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。

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3个工作日内进行复核，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5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10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15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密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部门公章的复核意见书，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证监会备案。

六、基金份额持有人名册的保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；

2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

七、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十六、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，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）资料寄送服务

1、基金投资者交易资料的对账服务

（1）基金份额持有人可登录本公司网站（http://www.mfcteda.com）查阅对账单。

（2）基金份额持有人也可向本公司定制纸质、电子或短信形式的定期或不定期对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

2、其他相关的信息资料

（二）基金间转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金

合同的规定制定并公告。

（三）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以定时定额申购基金份额。具体实施时间和业务规则另行公告。

本基金已于2011月12月22日起开始接受定期定额投资业务。具体实施方法详见相关公告。

（四）在线服务

基金管理人利用公司网站 http://www.mfcteda.com 定期或不定期为基金投资者提供投资策略分析报告以及与基金经理（或投资顾问）的定期在线交流的服务。

（五）资讯服务

泰达宏利客服中心为投资者提供7×24小时的电话语音服务，投资者可通过客服电话 400-698-8888 的语音系统或登录公司网站 http://www.mfcteda.com，查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间还将为投资者提供周到的人工答疑服务。

（六）投诉受理

投资者可以拨打泰达宏利基金管理有限公司客户服务中心电话400-698-8888或客服信箱：irm@mfcteda.com投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

二十七、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒体上公告。

1. 本基金管理人已于2015年12月3日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

2. 本基金管理人已于2015年12月4日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》。

3. 本基金管理人已于2015年12月10日发布《泰达宏利基金管理有限公司新增旗下部分基金在诺亚正行销售并参加其费率优惠活动的公告》。

4. 本基金管理人已于2015年12月25日发布《泰达宏利基金管理有限公司新增旗下部分基金在众禄金融销售并参加其费率优惠活动的公告》。

5. 本基金管理人已于2015年12月29日发布《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》。

6. 本基金管理人已于2015年12月29日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

7. 本基金管理人已于2015年12月30日发布《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告》。

8. 本基金管理人已于2015年12月30日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行申购费率及定投申购费率优惠活动的公告》。

9. 本基金管理人已于2015年12月30日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞银行申购费率及定投申购费率优惠活动的公告》。

10. 本基金管理人已于2015年12月31日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告》。

11. 本基金管理人已于2015年12月31日发布《关于泰达宏利基金淘宝官方旗舰店申（认）购费率优惠的公告》。

12. 本基金管理人已于2016年1月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

13. 本基金管理人已于2016年1月5日发布《关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金之泰达500A基金份额2016年上半年度约定年基准收益率公告》。

14. 本基金管理人已于2016年1月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间泰达500A份额停复牌的公告》。

15. 本基金管理人已于2016年1月6日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

16. 本基金管理人已于2016年1月6日发布《关于泰达宏利中证500指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》。

17. 本基金管理人已于2016年1月6日发布《关于泰达500A份额定期份额折算后次日前收盘价调整公告》。

18. 本基金管理人已于2016年1月8日、1月12日、1月13日、1月14日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

19. 本基金管理人已于2016年1月15日发布《泰达宏利中证500指数分级基金更新招募说明书》正文及摘要。

20. 本基金管理人已于2016年1月20日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

21. 本基金管理人已于2016年1月21日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海银行费率优惠的公告》。

22. 本基金管理人已于2016年1月22日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

23. 本基金管理人已于2016年1月22日发布《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金2015年第4季度报告》。

24. 本基金管理人已于2016年1月27日、1月29日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

25. 本基金管理人已于2016年1月29日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于新增旗下部分基金在北京展恒基金销售股份有限公司销售并参加其费率优惠活动的公告》。

26. 本基金管理人已于2016年2月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于调整在上海汇付金融服务有限公司代销的开放式基金申(认)购金额下限的公告》。

27. 本基金管理人已于2016年2月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

28. 本基金管理人已于2016年2月18日发布《泰达宏利基金管理有限公司新增旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司销售及参加其费率优惠活

动的公告》。

29. 本基金管理人已于2016年2月20日发布《泰达宏利基金管理有限公司新增旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司销售并参加其费率优惠活动的公告》。

30. 本基金管理人已于2016年2月25日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司网上交易与微信交易暂停服务的公告》。

31. 本基金管理人已于2016年2月25日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

32. 本基金管理人已于2016年2月26日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加平安证券有限责任公司费率优惠活动的公告》。

33. 本基金管理人已于2016年2月27日、3月1日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

34. 本基金管理人已于2016年3月3日发布《泰达宏利基金管理有限公司旗下部分基金参加陆金所费率优惠活动的公告》。

35. 本基金管理人已于2016年3月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

36. 本基金管理人已于2016年3月18日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。

37. 本基金管理人已于2016年3月18日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

38. 本基金管理人已于2016年3月30日发布《泰达宏利中证500指数分级证券投资基金2015年年度报告》正文及摘要。

39. 本基金管理人已于2016年4月6日、4月7日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

40. 本基金管理人已于2016年4月16日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告》。

41. 本基金管理人已于2016年4月20日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

42. 本基金管理人已于2016年4月21日发布《泰达宏利中证500指数分

级证券投资基金2016年第1季度报告》。

43. 本基金管理人已于2016年5月5日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告》。

44. 本基金管理人已于2016年5月7日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

45. 本基金管理人已于2016年5月7日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

46. 本基金管理人已于2016年5月7日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

47. 本基金管理人已于2016年5月10日、5月11日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

48. 本基金管理人已于2016年5月12日发布《关于泰达宏利基金管理有限公司网上交易和微信交易银联通兴业银行卡暂停服务的公告》。

49. 本基金管理人已于2016年5月12日、5月13日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

50. 本基金管理人已于2016年5月14日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

51. 本基金管理人已于2016年5月14日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

52. 本基金管理人已于2016年5月17日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告》。

53. 本基金管理人已于2016年5月19日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》。

54. 本基金管理人已于2016年5月25日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

55. 本基金管理人已于2016年5月25日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

上述公告的具体内容详见公告当日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及公司网站www.mfcteda.com。

二十八、招募说明书存放及查阅方式

招募说明书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，投资者可在办公时间查阅、复制；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(http://www.mfcteda.com)查阅和下载招募说明书。

二十九、备查文件

（一）本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、基金合同；

3、托管协议；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式

1、存放地点：基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

泰达宏利基金管理有限公司

2016 年 7 月 15 日