

# 融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）

## 基金合同

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一九年十二月

## 目 录

第一部分	前言.....	2
第二部分	基金的基本情况.....	8
第三部分	基金份额的发售.....	10
第四部分	基金备案.....	14
第五部分	基金份额的交易、申购和赎回.....	15
第六部分	基金合同当事人及权利义务.....	24
第七部分	基金份额持有人大会.....	31
第八部分	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	38
第九部分	基金的托管.....	40
第十部分	基金份额的登记.....	41
第十一部分	基金的投资.....	42
第十二部分	基金的财产.....	47
第十三部分	基金资产的估值.....	49
第十四部分	基金的费用与税收.....	54
第十五部分	基金的收益与分配.....	56
第十六部分	基金的会计与审计.....	58
第十七部分	基金的信息披露.....	59
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	66
第十九部分	违约责任.....	68
第二十部分	争议的处理.....	69
第二十一部分	基金合同的效力.....	70
第二十二部分	基金合同摘要.....	71

## 第一部分 前言

### 一、前言

订立《融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本合同”、或“本基金合同”）的目的是保护基金投资者合法权益、明确本基金合同当事人的权利与义务、规范融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）的运作。

订立本基金合同的依据是 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、2014 年 7 月 7 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于 2014 年 8 月 8 日起施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2019 年 7 月 26 日中国证监会发布并于 2019 年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、2017 年 8 月 31 日中国证监会颁布并于 2017 年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）以及深圳证券交易所相关业务规则及其他有关规定。

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益。

本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自基金合同签定并生效之日起成为基金合同的当事人。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享受权利，承担义务。

中国证监会对基金募集的核准，并不表明其对基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守，诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于基金一定盈利，也不保证最低收

益。

基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露的涉及本基金的信息，其内容涉及界定本基金合同当事人之间权利义务关系的，以本基金合同的规定为准。

本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 二、释义

在本基金合同中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）或融通巨潮 100 指数基金
基金合同或本基金合同：	指《融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充
招募说明书或本招募说明书：	指《融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
发售公告或本发售公告：	指《融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《运作办法》	指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、2013 年 6 月

	1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《信息披露办法》	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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
《流动性风险管理规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
业务规则	指深圳证券交易所、中国证券登记有限责任公司和基金管理人的相关业务规则
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构：	指中国银行业监督管理委员会、中国人民银行或其他经国务院授权的机构
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指融通基金管理有限公司
基金托管人：	指中国工商银行股份有限公司
销售场所：	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所
销售机构：	指基金管理人和基金销售代理人
基金销售代理人：	指依据有关销售代理协议办理基金销售的代理机构
会员单位：	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位
注册登记人：	指中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结

	算系统
证券登记结算系统:	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
个人投资者:	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者
机构投资者:	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、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暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的开放式证券投资基金的中国境外的机构投资者
基金募集期:	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
基金合同生效日:	指基金募集期结束并达到成立条件, 向中国证监会办理基金合同备案手续后, 收到其书面确认之日
基金存续期:	指基金合同生效至基金合同终止, 基金存续的不定期之期限
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日:	指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
T+n 日:	指自 T 日起第 n 个工作日 (不包含 T 日)
日/天:	指公历日
月:	指公历月
发售:	指场外认购和场内认购
场外认购:	指基金募集期内投资者通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为
场内认购:	指基金募集期内投资者通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为
日常交易:	指申购、赎回和上市交易
申购:	指基金存续期间投资者通过销售机构向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为

赎回：	指基金存续期间持有本基金份额的投资者通过销售机构向基金管理人提出申请卖出本基金份额的行为
销售服务费	指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广以及基金份额持有人服务的费用
基金份额类别	本基金根据销售费用收费方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 A 类基金份额；在投资者赎回时收取后端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 B 类基金份额；不收取前/后端申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为 C 类基金份额
上市交易	指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
系统内转托管	指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（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
开放式基金账户	指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统
证券账户	指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的证券登记结算系统
基金信息披露义务人	指基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、基金合同或操作障碍等原因无

	<p>法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p>
指定媒介	<p>指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介</p>
基金产品资料概要	<p>指《融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）</p>



## 第二部分 基金的基本情况

### 一、基金的名称

融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）

### 二、基金的类别

股票型基金

### 三、基金的运作方式

上市契约型开放式

### 四、基金投资目标

本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。

### 五、基金规模

不设固定的募集规模，最低募集份额总额为 2 亿份基金单位。

### 六、基金份额面值和认购费用

本基金份额的面值为人民币一元，按面值发售，投资者认购采用全额缴款的认购方式。

本基金的发售包括场内认购和场外认购两种方式。场内和场外的认购费率不高于 1.2%，随认购金额的增加而减少，如下表所示：

认购金额（M）	认购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 1000 万	1%

1000 万 $\leq$ M<2000 万	0.5%
M $\geq$ 2000 万	单笔 2000 元

## 七、基金份额净值

本基金A /B类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。T日基金份额净值在当天收市后计算，每份基金份额净值数值精确到0.001元，于T+1日公告。

## 八、基金存续期限

不定期

## 九、基金份额的类别

本基金根据销售费用收费方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为A类基金份额。A类基金份额持有人可在A类基金份额上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额，并可通过场内和场外进行申购和赎回；在投资者赎回时收取后端申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为B类基金份额；不收取前/后端申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为C类基金份额。B类基金份额和C类基金份额不上市交易，仅通过场外申购和赎回。

本基金A类、B类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A/B类和C类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。

投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

有关基金份额类别的具体设置等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。根据基金销售情况，在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

### 第三部分 基金份额的发售

本基金为上市契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2005 年 2 月 6 日证监基金字[2005]18 号文核准募集。

本基金的发售包括场外认购和场内认购两种方式。发售后登记在注册登记系统的基金份额适用“一、基金份额的场外认购”的相关规定，本规定不适用于发售后登记在证券登记结算系统的基金份额；发售后登记在证券登记结算系统的基金份额适用“二、基金份额的场内认购”的相关规定，本规定不适用于发售后登记在注册登记系统的基金份额。

除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

#### 一、基金份额的场外认购

##### （一）基金份额的募集期限、销售渠道、发售对象

- 1、募集期限：自基金份额发售之日起不超过 3 个月。
- 2、销售渠道：本公司的直销网点和销售代理机构的代销网点（具体名单见发售公告）。
- 3、发售对象：合格的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

##### （二）认购的时间

具体时间由基金管理人与销售代理人约定（见发售公告及销售代理人相关公告）。

##### （三）认购的程序

- 1、申请方式：书面申请或管理人公布的其他方式。
- 2、认购款项支付：基金投资者认购时，采用全额缴款方式，若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

#### （四）募集目标

本基金场外认购不设固定的募集目标。

#### （五）认购方式与费率结构

投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但认购资金一旦交付，撤销申请不予接受。

本基金份额的面值为人民币一元，按面值发售，投资者认购采用全额缴款的认购方式。

本基金的认购费率不高于 1.2%，随认购金额的增加而减少，如下表所示：

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 1000 万	1.0%
1000 万 ≤ M < 2000 万	0.5%
M ≥ 2000 万	单笔 2000 元

#### （六）认购的确认

当日 (T 日) 在规定时间内提交的申请，投资者通常可在 T+2 日到网点查询交易情况，在募集截止四个工作日后可以到网点打印交易确认书。

#### （七）认购的数额约定

本基金代销机构首次认购最低金额为人民币 1000 元，追加认购的最低金额为人民币 1000 元。直销网点每次认购的最低金额为人民币 10 万元，追加认购的最低金额为人民币 10 万元。

#### （八）认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记人的记录为准。

#### （九）有关本基金认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购的方式。认购份额的计算采用四舍五入的方法保留至 0.01 份，由此产生的误差计入基金资产。

本基金认购份额的计算如下：

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率}) \times \text{认购费率}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{利息}) / \text{基金份额面值}$$

## 二、基金份额的场内认购

### （一）基金份额的募集期限、销售渠道、发售对象

- 1、募集期限：自基金份额发售之日起不超过 3 个月。
- 2、销售渠道：本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，销售渠道为深圳证券交易所会员单位（具体名单见发售公告）。
- 3、发售对象：合格的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

### （二）认购的时间

在发售期内，深圳证券交易所将于交易日交易时间内持续挂牌定价销售本基金份额（具体时间见发售公告）。

### （三）募集目标

本基金场内认购不设固定的募集目标。

### （四）认购方式与费率结构

投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但认购资金一旦交付，撤销申请不予接受。

本基金份额的面值为人民币一元，挂牌价格为基金面值。投资者认购采用全额缴款的认购方式。

投资者场内认购需缴纳认购费用。

本基金的认购费率不高于 1.2%，随认购金额的增加而减少，如下表所示：

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 1000 万	1.0%
1000 万 ≤ M < 2000 万	0.5%
M ≥ 2000 万	单笔 2000 元

### (五) 认购的数额约定

本基金场内认购最低份额为 1000 份，每次申报的追加认购份额必须为 1000 份或其整数倍且不超过 99,999,000 份基金单位。

### (六) 认购期利息的处理方式

认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的份额保留至 1 份，余额计入基金资产。

### (七) 认购金额和利息折算的份额的计算

本基金场内认购采用份额认购的方式。本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：

认购金额 = 挂牌价格 × (1 + 认购费率) × 认购份额

认购费用 = 挂牌价格 × 认购份额 × 认购费率

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

利息折算的份额 = 利息 / 挂牌价格

## 第四部分 基金备案

### 一、基金合同生效的条件

基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下，基金管理人依法向中国证监会办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时基金管理人应当承担的责任

（一）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（二）在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第五部分 基金份额的交易、申购和赎回

本基金 A 类基金份额的日常交易包括上市交易和通过场内、场外申购赎回两种方式，B 类基金份额和 C 类基金份额不上市交易，仅通过场外申购和赎回。登记在证券登记结算系统的 A 类基金份额进行日常交易时适用“一、基金份额的上市交易”的相关规定，本规定不适用于登记在注册登记系统的 B 类基金份额和 C 类基金份额；登记在注册登记系统的 B 类基金份额和 C 类基金份额进行日常交易时适用“二、基金份额的申购和赎回”的相关规定。

### 一、基金份额的上市交易

#### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

#### （二）上市交易的时间

本基金合同生效后 3 个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

#### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日 A 类基金份额的基金份额净值；
- 2、本基金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、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《上市规则》等相关规定。

#### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定，比照封闭式基金的有关规定办理。



### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统揭示基金前一交易日的 A 类基金份额的基金份额净值。

### （六）上市交易的注册登记

投资者 T 日买入成功后，注册登记人在 T 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+1 日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资者 T 日卖出成功后，注册登记人在 T 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

### （七）上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

### （八）暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人；
- 2、基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份；
- 3、违反国家有关法律、法规、被中国证监会决定暂停上市；
- 4、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在指定媒介上刊登暂停上市公告。

### （九）恢复上市的公告

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在指定媒介上刊登恢复上市公告。

### （十）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时 本基金应终止上市交易：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；

- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由深圳证券交易所终止本基金的上市交易，并由基金管理人报中国证监会备案，基金管理人应在指定媒介上刊登终止上市公告。

## 二、基金份额的申购和赎回

### （一）申购和赎回场所

- 1、本公司直销网点；
- 2、经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

本基金合同生效后 3 个月内开始办理申购、赎回。

申购、赎回的开放日为证券交易所交易日，在开放日的具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。

在确定了基金开放日申购、赎回的时间后，由基金管理人最迟在开放前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

### （三）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的该类别基金份额净值为基准进行计算。

2、在场外，“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；在场内，基金份额的申购以金额申报，申报单位为一元人民币；赎回以份额申报，申报单位为一份基金份额。

3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

### （四）申购和赎回的程序

- 1、申请方式：书面申请、委托证券经营机构向深圳证券交易所系统申报或基

金管理人公布的其他方式。

2、确认与通知：当日（T 日）在规定时间内之前提交的申请，投资者可在 T+2 日到网点查询申购、赎回的确认情况。

3、款项支付：基金申购采取全额缴款的方式，若申购资金在规定时间内未全额到账（指到达基金份额发售机构指定申购账户）则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款将退回投资者账户。基金份额持有人赎回本基金申请确认后，赎回款项将在 T+5 日内划往基金份额持有人账户。在发生延期赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

### （五）申购和赎回的数额约定

1、本基金代销机构首次申购和追加申购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准。本基金直销网点最低申购金额由基金管理人制定和调整；

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，具体规定参见招募说明书或相关公告；

3、基金管理人可根据市场情况，调整申购、赎回份额的数量限制，调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体规定参见招募说明书或相关公告。

5、申购份额及余额的处理方式：本基金的场外申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类别基金份额净值为基准计算并保留小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归基金资产。场内申购份额保留到整数位，零碎份额对应的资金返还至投资者资金账户；

6、赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类别基金份额净值为基准计算并扣除相应的费用。计算结果保留小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归基金资产。

### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金A/B类基金份额的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，

主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。C类基金份额不收取申购费用。

2、本基金A/B类基金份额的赎回费用由赎回人承担，在扣除销售代理费用和注册登记费等相关手续费后，余额不低于赎回费总额的25%，并归入基金财产。

3、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。

4、本基金的前端申购费率最高不超过1.5%，赎回费率最高不超过0.5%，除对持续持有期限少于7日的基金份额持有人，本基金将收取不少于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额归入基金财产。

5、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。基金管理人可以调整费率或收费方式，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （七）申购份额和赎回金额的计算方式

1、本基金各类基金份额申购份额和赎回金额的计算方式和余额处理方式在招募说明书或相关公告中列示。

2、本基金每个工作日公告各类基金份额的基金份额净值，当日各类基金份额净值在当天收市后计算，并在下一工作日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### （八）申购和赎回的注册登记

投资者T日场外申购基金成功后，注册登记人在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额；投资者T日场外赎回基金成功后，注册登记人在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

本基金场内申购和赎回的注册登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

基金管理人可以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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受基金投资者的申购申请：

1、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；

2、基金场内交易停牌时；

3、不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

4、证券交易所非正常停市；

5、有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他暂停申购情形；

6、当基金管理人认为某笔申购申请会影响到其他基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，可拒绝该笔申购申请。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形时。

8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

9、当申购申请超过基金管理人设定的单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限的。

发生上述 1 到 5 项、第 8 项暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒介上刊登暂停申购公告；

发生上述第 6、7、9 项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒介上刊登暂停申购公告。

#### **(十) 暂停赎回或延续支付赎回款项的情形**

本基金必须保持足够的现金或者政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。但是发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

2、证券交易所非正常停市；

3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人合法权益的基金赎回行为；

5、基金场内交易停牌时；

6、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人在当日向中国证监会报告，已接受的申请，基金管理人足额兑付；如暂时不能足额兑付，可兑付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以该类别基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要暂停基金赎回，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停公告。

### **(十一) 巨额赎回的情形及处理方式**

#### **1、巨额赎回的认定**

指在单个开放日内，本基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（该基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

#### **2、巨额赎回的处理方式**

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，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而进行的资产变现可能对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 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，按单个账户赎回申请量占

赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入下一个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日该类别的基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。在发生巨额赎回的情况下，当日未获受理的场内赎回将自动撤销。

本基金发生巨额赎回时，对于在开放日单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 30% 以上的赎回申请，可以全部自动进行延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

3、巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应通过指定媒介在 2 日内刊登公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

## (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，暂停结束后基金管理人应在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日本基金各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金各类基金份额净值。

### 三、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

#### （一）基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的各类基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的 A 类基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

#### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指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（席位）之间进行转托管的行为。

2、份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、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上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### （三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指持有人将持有的 A 类基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、持有人拟申请将登记在证券登记结算系统中的基金份额赎回，或拟申请将登记在注册登记系统中的基金份额进行上市交易，应先办理跨系统转登记，即将登记在证券登记结算系统中的基金份额转登记到注册登记系统，或将登记在注册登记系统中的基金份额转登记到证券登记结算系统。

3、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。



## 第六部分 基金合同当事人及权利义务

### 一、基金合同的当事人

#### （一）基金管理人

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

法定代表人：高峰

成立时间：2001年5月22日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2001]8号

组织形式：有限责任公司

实收资本：12500万元人民币

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和设立文号：1983 年 9 月 17 日国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：35,640,625.71 万元人民币

存续期间：持续经营

#### （三）基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对本基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据本基金合同发售的基金份额，即成为本基金份额持有人和

本基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

## 二、基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定运用并管理基金财产；

(2) 依据基金合同的规定，获得基金管理人的管理费、其他法定收入和法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 提议召开基金份额持有人大会；

(4) 监督本基金的托管行为，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家法律法规，应呈报中国证监会和银行业监管机构，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(6) 发售基金份额；

(7) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；

(8) 担任注册登记人，委托其他机构担任注册登记人，更换注册登记人；

(9) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(10) 以自身名义，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；

(11) 依据有关法律规定及本基金合同制定或决定基金收益的分配方案；

(12) 在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，暂停受理申购、赎回申请或暂停上市交易；

(13) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；

(14) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

### 2、基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

- (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) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算, 编制财务会计报告及基金报告。
- (5) 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;
- (6) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务;
- (7) 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管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;
- (8) 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;
- (9) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
- (10) 依法接受基金托管人的监督;
- (11) 按规定计算并公告基金净值信息;
- (12) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
- (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) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
- (17) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- (18) 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；

(19) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(20) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；保证基金投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(21) 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；

(22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(23) 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；

(24) 监督基金托管人按照基金合同规定履行义务，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；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

### 三、基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金财产；

(2) 依据本基金合同约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 依据有关法规监督基金管理人对本基金的投资运作，如认为基金管理人违反了本基金合同及国家法律法规，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(5) 提议召开基金份额持有人大会；

(6) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 依法持有基金资产；
- (3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；
- (4) 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；
- (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, 确保基金资产的安全, 保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立; 对不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (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, 不得委托第三人托管基金财产；
- (7) 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；
- (8) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户。以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户, 以基金托管人及基金联名的方式开立基金证券账户, 以基金的名义开立银行间债券托管账户, 负责基金投资于证券的清算交割, 执行基金管理人的划款指令, 并负责办理基金名下的资金往来；
- (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保密, 不得向他人泄露；
- (10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- (11) 采用适当、合理的措施, 使基金投资和融资的条件符合本基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 按规定出具基金托管情况的报告, 复核基金业绩报告, 并报银行业监管机构和中国证监会；
- (13) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人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；

- (14) 按有关规定, 保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上;
- (15) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (17) 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;
- (18) 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;
- (19) 参加基金清算小组, 参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和银行业监管机构, 并通知基金管理人;
- (21) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- (22) 监督基金管理人按照基金合同规定履行义务, 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- (23) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
- (24) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (25) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

#### 四、基金份额持有人的权利与义务

##### 1、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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为

依法提起诉讼；

（9）有关法律、法规和基金合同约定的其他权利。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

## 2、基金份额持有人的义务

（1）遵守基金合同；

（2）交纳基金认购、申购款项及规定的费用；

（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及基金份额持有人合法权益的活动；

（5）有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

## 第七部分 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本部分所涉及数字，含有“以上”表述的，均不包括该数字在内；含有“不少于”表述的，均包含该数字在内。

### 一、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1、提前终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费（但根据法律法规的要求调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外）；
- 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程序；
- 8、对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- 9、《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低销售服务费；
- 2、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的申购费率、赎回费率或收费方式；



- 3、因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- 4、对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的变更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它情形。

## 二、召集人和召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

3、代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；

4、代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日在中国证监会指定的信息披露媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开时间、地点、方式；
- (2) 会议审议事项、议事程序、表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 代理投票委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 其他注意事项。

2、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

### 四、基金份额持有人出席会议的方式

#### 1、会议方式

- (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- (2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- (3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- (4) 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事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金份额持有人大会召开条件

- (1) 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当不少于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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

## (2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

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它代表，同时提交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。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容仅限于本基金合同第七部分“一、召开事由”中所指的关系

基金份额持有人利益的重大事项；

(2) 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；

(3) 基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 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；

(4) 对于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：

1) 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；

2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 六、决议形成的条件、表决方式、程序

### (一) 决议形成的条件、表决方式

- 1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。
- 2、基金份额持有人不得就未经公告的事项进行表决。
- 3、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效；除下列 (2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

- 4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 5、对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### (二) 程序

#### 1、现场开会

如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选

举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人；

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

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；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，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。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 七、公告时间与方式

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两日内在中国证监会指定的信息披露媒介公告。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

## 第八部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### 一、基金管理人和基金托管人的更换条件

#### （一）基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，可更换基金管理人：

- 1、基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- 2、被依法取消基金管理资格；
- 3、被基金份额持有人大会解任；
- 4、法律、法规规定的其他情形。

#### （二）基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，可更换基金托管人：

- 1、基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- 2、被依法取消基金托管资格；
- 3、被基金份额持有人大会解任；
- 4、法律、法规规定的其他情形。

### 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

#### （一）基金管理人的更换程序

- 1、提名：新任基金管理人由基金托管人提名；
- 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议；
- 3、临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人
- 4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；
- 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告。新任基金管理人与原基金管理人进

行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定的媒介上公告。基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收；

6、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告同时报中国证监会备案；

7、基金名称变更：基金管理人更换后，如果融通基金管理有限公司要求，应按其要求替换或删除基金名称中“融通”的字样。

## （二）基金托管人的更换程序

1、提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议；

3、临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定的媒介上公告。基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收；

6、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案。



## 第九部分 基金的托管

基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 第十部分 基金份额的登记

一、本基金的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

二、本基金的注册登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。基金管理人应与基金注册与过户登记人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

三、注册登记机构享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、法律法规规定的其它权利。

四、注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3、向基金管理人提供完整的基金帐务信息；
- 4、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 5、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；
- 6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其它情形除外；
- 7、按本基金合同及招募说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其它必要的服务；
- 8、法律法规规定的其它义务。

## 第十一部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮100目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮100目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。

### 二、目标指数

本基金以巨潮100指数作为目标指数。巨潮100指数是由深圳证券信息公司负责编制并维护的成份股指数，该指数以深沪两市所有股票一定时间范围内的流通市值及成交量的加权指标排名为选股标准，同时对上市不满3个月、ST类、公司财务出现重大问题、股价出现异常波动等的股票进行了剔除，指数每半年调整一次，为了避免指数成份股出现的频繁变动，确保指数可投资性与抗操纵性，指数的调整规则中运用了缓冲区技术。巨潮100指数的基期为2002年12月31日，基日指数为1000点。

如果巨潮100指数被停止发布或由其他指数替代或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，变更基金的跟踪目标和投资对象。

本基金由于上述原因变更跟踪目标和投资对象，不需召开基金份额持有人大会通过，但应报中国证监会，并在中国证监会指定的媒介上公告。

### 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，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮100指数的成份股和预期将要被选入巨潮100指数的股票，本基金还可适当投资一级市场的

股票 (包括新股与增发)。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的10%以内,但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。

#### 四、投资策略

本基金为增强型指数基金,在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上,力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在0.5%。

##### (一) 决策依据和决策程序

1、研究策划部提供宏观经济、行业分析以及公司的研究报告;风险管理部利用量化模型进行投资组合优化和跟踪误差模拟测算,在此基础上进行投资论证,做出投资建议提交给基金经理,并为投资决策委员会提供资产配置决策依据。

2、基金经理根据风险管理部提交的指数组合优化及风险测算的结果以及研究策划部提交的投资建议初步决定下一阶段的投资组合,形成资产配置提案报投资决策委员会。

3、投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案形成资产配置计划书。

4、基金经理根据投资决策委员会的决策制定相应的指数化投资组合投资方案,对超出基金经理权限的投资决策须报投资决策委员会审议批准。

5、基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,并以投资指令的形式下达至基金交易部。

6、基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

7、风险管理部负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估,定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时,通知基金经理和相关部门及时进行投资组合的调整。

8、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

## （二）投资管理的方法和标准

### 1、仓位控制策略

本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的90%—95%；保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。实际运作过程中，由于受市场价格波动、股票交易的零股限制、基金申购赎回情况等因素的影响，基金的资产未达限定比例要求的，基金经理将对此进行实时监控并在十个交易日内做出相应的调整。

### 2、指数化投资策略

本基金以复制法作为股票指数化投资部分的主要投资方法。对于因流动性等原因导致基金管理人无法复制巨潮100指数的情况，本基金将采用剩余替换等方法避免由此引起的跟踪误差扩大。

### 3、增强型投资策略

本基金以指数化投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以有限度的增强投资及一级市场股票投资。其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是抵消基金运作中不可避免的负向超额收益，如管理费、托管费、交易费用等。增强操作的依据是：

（1）行业基本面信息的深入挖掘及行业景气周期的综合判断。

（2）公司基本面的挖掘及绝对、相对估值研究。

（3）股票的流动性分析。主要根据对当时市场成交活跃程度及股票过往的平均换手率、交易量等因素的分析，对个股的流动性及其对指数基金组合构建及调整有可能产生的影响进行分析预测。

（4）指数成份股的提前或延后更换。本基金将根据目标指数的编制规则，预测指数成份股可能发生的变动以及对股价有可能产生的影响，适度提前或延后成份股的调整。

#### 4、其它投资策略

本基金将审慎投资于中国证监会批准的其它金融工具，以减少基金财产的风险并提高收益。

#### 五、业绩比较基准

巨潮100指数收益率\*95%+银行同业存款利率\*5%。

#### 六、风险收益特征

风险和预期收益率接近市场平均水平。

#### 七、投资限制

##### (一) 基金财产不得用于下列投资或者活动

- 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、向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6、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；
- 7、依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

对于因上述第5项情形导致无法投资的巨潮100指数成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，用剩余组合替换法对无法投资的成份股进行替换。

##### (二) 本基金投资组合比例限制

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、股票、债券和现金的投资比例应符合本基金合同规定的投资比例限制;

3、本基金管理人管理的全部开放式基金持有上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的15%, 但完全按照目标指数的构成比例进行证券投资不受此限;

4、本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的30%, 但完全按照目标指数的构成比例进行证券投资不受此限;

5、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

6、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

7、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3个月内达到规定的标准。

除上述第5、6项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

## 第十二部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金通过发行基金份额方式募集资金，并进行证券投资等交易所形成的各类资产的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其它投资及其估值调整；
- 9、其它资产等。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金财产总值扣除负债后的净资产值。

其构成主要有：

- 1、基金份额持有人申购、赎回基金份额所发生的款项；
- 2、运用基金财产所获得收益（亏损）；
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

### 三、基金财产的账户

本基金财产使用以基金托管人名义开立的基金托管专户和证券交易资金账户，并以基金托管人和“融通巨潮100指数证券投资基金（LOF）”联名的方式开立基金证券账户、以“融通巨潮100指数证券投资基金（LOF）”的名义开立债券托管



乙类账户并报有关监管机构备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册与过户登记人自有的资产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### **四、基金财产的处分**

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有资产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有资产。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资产和收益，归入基金财产。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资产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十三部分 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是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购、赎回与转换价格的基础。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### 四、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人复核。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；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。

### 五、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。

如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;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)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市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权,从配股除权日起到配股确认日止,如果收盘价高于配股价,按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

5、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。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按

国家最新规定估值。根据《基金法》，基金管理人计算基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 六、基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应

当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认, 确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对差错的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责, 如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失 (“受损方”), 则差错责任方应赔偿受损方的损失, 并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利; 如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方, 则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时, 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿, 如果因基金托管人过错造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失, 并拒绝进行赔偿时, 由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定, 基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任, 则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索, 并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给每一单一当事人造成10元人民币以上的损失。

(8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因, 列明所有的当事人, 并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金注册登记机构的交易数据的, 由基金注册登记机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认;

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当报告中国证监会; 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### 七、暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 基金管理人经与基金托管人协商确认的;

4、中国证监会认定的其他情形。

### 八、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

2、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、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。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

### 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为每日C类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金销售服务费用于基金的销售与基金份额持有人的服务等。

3、上述一中第4—8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

基金成立前所产生的费用、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

## 四、基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。



## 第十五部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益的构成

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

### 二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### 三、基金收益分配原则

- 1、本基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的90%；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。其中，托管于证券登记结算系统的基金份额的分红方式只能是现金分红。托管于注册登记系统的基金份额分红方式可为现金分红方式或分红再投资方式，本基金默认的收益分配方式是现金分红；分红再投资部分以除息日的该类基金份额净值为计算基准确定再投资份额；
- 3、基金收益分配每年最多12次。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配1次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- 4、基金若存在以前年度未弥补亏损，基金当年收益应先弥补以前年度未弥补亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；
- 6、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、由于本基金A/B类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **四、收益分配方案**

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照基金注册登记人的业务规定执行。

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金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各自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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表及其他规定事项进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十七部分 基金的信息披露

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。

### 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及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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。

**本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，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销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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。

## 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 一、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

1、《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。

2、基金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。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基

金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## 二、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

## 三、基金募集情况公告

基金管理人应当就基金份额发售的结果编制基金募集情况公告，并在募集期结束的次日登载于指定媒介上。

## 四、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

## 五、基金份额上市交易公告书

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

## 六、基金净值信息

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在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的A/B类及C类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的A/B类及C类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## 八、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

法律法规或中国证监会关于基金信息披露的内容与格式准则如有调整的，以相关最新规定为准。

## 九、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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算、基金终止上市交易；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 13、基金收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 15、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值0.5%；



- 16、本基金开始办理申购、赎回；
- 17、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；
- 20、本基金发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 21、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 十、基金份额持有人大会决议

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。

## 十一、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒介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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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、基金上市交易的证券交易所。

## 十二、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 十三、中国证监会规定的其他信息。

### 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，指定专门部门及

高级管理人员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等法律法规规定。

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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

### **信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

**本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。**

## 第十八部分 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、本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意；
- 2、变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。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变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，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变更后公布，并报中国证监会备案。

### 二、基金合同的终止

- 1、出现下列情况之一的，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、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
  - (3) 基金合同约定的其他情形；
  - (4) 中国证监会允许的其他情况。
- 2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。

### 三、基金财产的清算

- 1、清算小组
  - (1) 自基金合同终止之日起3个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。
  - (2) 清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。清算小组可以聘请

必要的工作人员。

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

## 2、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金资产；
- (2) 清算小组对基金资产进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行估价；
- (4) 对基金资产进行变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 进行基金剩余资产的分配；
- (8) 基金财产清算的期限为6个月。

## 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

## 4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5、基金清算的公告

清算小组作出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后5个工作日内由清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存15年以上。

## 第十九部分 违约责任

一、由于基金合同当事人的违约行为造成基金合同不能履行或者不能完全履行的，由有违约的一方承担违约责任；如属基金合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，双方或多方当事人应当按照法律法规和基金合同的规定分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有故意或过失的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则而投资或不投资而造成的损失等；

3、不可抗力。

二、基金合同当事人违反基金合同，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

三、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。未违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。

## 第二十部分 争议的处理

一、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

二、基金管理人和基金托管人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会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。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

三、基金份额持有人或基金投资者作为一方当事人与基金管理人、基金托管人的一方或数方作为另一方当事人之间发生争议，首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权向有管辖权的人民法院起诉，也可将事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

## 第二十一部分 基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、本基金合同经基金管理人和基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，基金合同在基金募集结束，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

2、基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、本基金合同可印制成册并对外公开散发或存放在基金管理人和基金托管人的营业场所供投资者免费查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二十二部分 基金合同摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

##### 1、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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 有关法律、法规和基金合同约定的其他权利。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

##### 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (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及基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

#### (二) 基金管理人的权利与义务

##### 1、基金管理人的权利

- (1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定运用并管理基金财产；
- (2) 依据基金合同的规定，获得基金管理人的管理费、其他法定收入和法律



法规允许或监管部门批准的约定收入；

(3) 提议召开基金份额持有人大会；

(4) 监督本基金的托管行为，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家法律法规，应呈报中国证监会和银行业监管机构，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(5) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(6) 发售基金份额；

(7) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；

(8) 担任注册登记人，委托其他机构担任注册登记人，更换注册登记人；

(9) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(10) 以自身名义，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；

(11) 依据有关法律规定及本基金合同制定或决定基金收益的分配方案；

(12) 在基金存续期内，依据有关的法律法规和本基金合同的规定，暂停受理申购、赎回申请或暂停上市交易；

(13) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；

(14) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(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) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算，编制财务会计报告及基金报告。

(5) 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；

(6) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎

回和其他业务或委托其他机构代理该项业务；

(7) 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管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(8) 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;

(9) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

(10) 依法接受基金托管人的监督;

(11) 按规定计算并公告基金净值信息;

(12) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

(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) 按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(17) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(18) 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;

(19) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;

(20) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定的时间内发出;保证基金投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;

(21) 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;

(22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告

中国证监会并通知基金托管人；

(23) 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;

(24) 监督基金托管人按照基金合同规定履行义务, 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;

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(26) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起, 依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金财产;

(2) 依据本基金合同约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入;

(3) 依据有关法规监督基金管理人对本基金的投资运作, 如认为基金管理人违反了本基金合同及国家法律法规, 应呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

(5) 提议召开基金份额持有人大会;

(6) 有关法律、法规和基金合同规定的其他权利。

#### 2、基金托管人的义务

(1) 遵守基金合同;

(2) 依法持有基金资产;

(3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产;

(4) 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;

(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, 确保基金资产的安全, 保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立; 对不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(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,不得委托第三人托管基金财产;

(7) 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;

(8) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户。以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户,以基金托管人及基金联名的方式开立基金证券账户,以基金的名义开立银行间债券托管账户,负责基金投资于证券的清算交割,执行基金管理人的划款指令,并负责办理基金名下的资金往来;

(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保密,不得向他人泄露;

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;

(11) 采用适当、合理的措施,使基金投资和融资的条件符合本基金合同等有关法律文件的规定;

(12) 按规定出具基金托管情况的报告,复核基金业绩报告,并报银行业监管机构和中国证监会;

(13) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人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;

(14) 按有关规定,保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上;

(15) 建立并保存基金份额持有人名册;

(16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(17) 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;

(18) 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;

(19) 参加基金清算小组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会和银行业监管机构,并通知基金管理人;

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

(22) 监督基金管理人按照基金合同规定履行义务, 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

(23) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(24) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(25) 有关法律、法规和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本部分所涉及数字, 含有“以上”表述的, 均不包括该数字在内; 含有“不少于”表述的, 均包含该数字在内。

### (一) 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的, 经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上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) 提议时, 应当召开基金份额持有人大会:

- 1、提前终止基金合同;
- 2、转换基金运作方式;
- 3、调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费 (但根据法律法规的要求调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外);
- 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程序;
- 8、对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项;
- 9、《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更, 不需召开基金份额持有人大会:

- 1、调低销售服务费；
- 2、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- 4、对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5、对基金合同的变更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它情形。

## （二）召集人和召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

3、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日在中国证监会指定的信息披露媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开时间、地点、方式；
- （2）会议审议事项、议事程序、表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）代理投票委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名、电话；
- （6）其他注意事项。

2、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

#### 1、会议方式

- （1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- （2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- （3）通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- （4）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事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金份额持有人大会召开条件

##### （1）现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

- 1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当不少于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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

## (2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

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它代表，同时提交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。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容仅限于本基金合同第七部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

(2) 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；

(3) 基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 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；

(4) 对于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：



1) 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；

2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (六) 决议形成的条件、表决方式、程序

### 1、决议形成的条件、表决方式

- (1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。
- (2) 基金份额持有人不得就未经公告的事项进行表决。
- (3) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

(6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 2、程序

### (1) 现场开会

如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人；

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

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；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，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。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

### （七）公告时间与方式

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两日内在中国证监会指定的信息披露媒介公告。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### （一）基金收益分配原则

1、本基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的90%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。其中，托管于证券登记结算系统的基金份额的分红方式只能是现金分红。托管于注册登记系统的基金份额分红方式可为现金分红方式或分红再投资方式，本基金默认的收益分配方式是现金分红；分红再投资部分以除息日的该类基金份额净值为计算基准确定再投资份额；

3、基金收益分配每年最多12次。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配1次，但若成立不满3个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；

4、基金若存在以前年度未弥补亏损，基金当年收益应先弥补以前年度未弥补亏损后，方可进行当年收益分配；

5、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；

6、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

7、由于本基金A/B类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## （二）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## （四）基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照基金注册登记人的业务规定执行。

## 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

### （一）基金的费用种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

### （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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 3、C类基金份额的销售服务费

本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为每日C类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金销售服务费用于基金的销售与基金份额持有人的服务等。

3、上述一中第4—8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

基金成立前所产生的费用、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （一）投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票，本基金还可适当投资一级市场的股票（包括新股与增发）。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10% 以内，但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。

#### （二）投资限制

##### 1、基金财产不得用于下列投资或者活动

- （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）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）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；
- （7）依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

对于因上述第5项情形导致无法投资的巨潮100指数成份股，基金管理人将在

严格控制跟踪误差的前提下，用剩余组合替换法对无法投资的成份股进行替换。

## 2、本基金投资组合比例限制

(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) 股票、债券和现金的投资比例应符合本基金合同规定的投资比例限制;

(3) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%,但完全按照目标指数的构成比例进行证券投资不受此限;

(4) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%,但完全按照目标指数的构成比例进行证券投资不受此限;

(5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(6) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(7) 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3个月内达到规定的标准。

除上述第(5)、(6)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金财产总值扣除负债后的净资产值。

其构成主要有:

- 1、基金份额持有人申购、赎回基金份额所发生的款项;
- 2、运用基金财产所获得收益(亏损);
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

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

当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的A/B类及C类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的A/B类及C类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）基金合同的变更

1、本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意；

2、变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。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变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，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变更后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，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、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）基金合同约定的其他情形；

（4）中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。

### （三）基金财产的清算

1、清算小组

（1）自基金合同终止之日起3个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组



必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

## 2、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金资产；
- (2) 清算小组对基金资产进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行估价；
- (4) 对基金资产进行变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 进行基金剩余资产的分配；
- (8) 基金财产清算的期限为6个月。

## 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

## 4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5、基金清算的公告

清算小组作出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后5个工作日内由清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存15年以上。

## 八、争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人和基金托管人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会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。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

3、基金份额持有人或基金投资者作为一方当事人与基金管理人、基金托管人的一方或数方作为另一方当事人之间发生争议，首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权向有管辖权的人民法院起诉，也可将事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

## 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册并对外公开散发或存放在基金管理人和基金托管人的营业场所供投资者免费查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。