

---

# 广发基金管理有限公司

## 广发中小板 300 交易型开放式指数 证券投资基金基金合同

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 目 录

一、前言.....	1
二、释义.....	2
三、基金的基本情况.....	8
四、基金份额的发售与认购.....	9
五、基金备案.....	11
六、基金份额折算和变更登记.....	12
七、基金份额的交易.....	13
八、基金份额的申购与赎回.....	15
九、基金认购、申购和赎回等业务的代理.....	20
十、基金合同当事人及权利义务.....	21
十一、基金份额持有人大会.....	28
十二、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	36
十三、基金的托管.....	39
十四、基金份额的登记结算.....	40
十五、基金的投资.....	41
十六、基金的财产.....	47
十七、基金资产的估值.....	48
十八、基金的费用与税收.....	54
十九、基金的收益与分配.....	58
二十、基金的会计和审计.....	60
二十一、基金的信息披露.....	61
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	68
二十三、违约责任.....	71
二十四、争议的处理.....	72
二十五、基金合同的效力.....	73
二十六、其他事项.....	74
二十七、基金合同内容摘要.....	75

## 一、前言

### (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作，保障基金财产的安全。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)、《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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益。

(二)基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。本基金合同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本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本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有权利、承担义务。

(三)广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。

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。

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，

但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致基金合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定存在冲突之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更或调整，同时就该等变更或调整进行公告。

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 二、释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、交易型开放式指数基金：指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，又称“ETF（Exchange Traded Fund）”或者“ETF 基金”，即指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券进行申购、赎回，并在深圳证券交易所上市交易
- 3、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF（以下简称目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。简称联接基金
- 4、基金管理人或本基金管理人：指广发基金管理有限公司
- 5、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 6、基金合同或本基金合同：指《广发中小板 300 交易型开放式指数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

7、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

8、招募说明书：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，及其更新

9、基金份额发售公告：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》

10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

12、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订

13、《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

14、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

15、《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

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

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

19、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

20、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

21、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

22、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

23、基金投资者：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者

24、基金份额持有人：指依据基金合同和招募说明书合法取得基金份额的基金投资者

25、销售机构：指直销机构和代销机构

26、直销机构：指广发基金管理有限公司

27、代销机构：指发售代理机构、申购赎回代理券商

28、发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

29、申购赎回代理券商：指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

30、基金销售网点：指直销机构及代销机构的代销网点

31、登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务

32、基金登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司

33、基金账户：指基金登记结算机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

34、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

35、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

36、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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

37、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

38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日：指深圳证券交易所的正常交易日

40、日：指公历日

41、月：指公历月

42、T 日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

43、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

44、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

45、认购：指在本基金募集期间，基金投资者申请购买本基金基金份额的行为，基金投资者可以现金或股票方式申请认购

46、发售：指在本基金募集期间，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

47、申购：指在基金存续期内，基金投资者按本基金合同规定的条件，向基金管理人申请购买本基金基金份额的行为

48、赎回：指在基金存续期内，基金份额持有人按本基金合同规定的条件，向基金管理人要求卖出本基金基金份额的行为

49、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

50、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

51、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

52、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

53、标的指数：指深圳证券交易所编制并发布的中小板 300 价格指数及其未来可能发生的变更

54、完全复制法：指一种跟踪指数的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例以构建指数组

合，达到复制指数的目的

55、现金替代：指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

56、现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按 T 日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

57、最小申购、赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

58、基金份额参考净值：指深圳证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

59、预估现金差额：指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商（代办证券公司）预先冻结

60、基金份额折算：指本基金建仓结束后，基金管理人根据本基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为

61、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施变更所持基金份额销售机构的操作

62、元：指人民币元

63、基金收益：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

64、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

65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

66、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

67、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

68、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法



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

69、指定媒介：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

70、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，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

71、基金产品资料概要：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。

### 三、基金的基本情况

(一)基金的名称

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金

(二)基金的类别

股票型证券投资基金

(三)基金的运作方式

交易型开放式

(四)基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(五)标的指数

中小板 300 价格指数。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数。

(六)基金的最低募集份额总额和金额

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。

(七)基金份额初始面值和认购费用

基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率不高于认购金额的 5%，具体费率情况在招募说明书和发售公告中列示。

(八)基金存续期限

不定期。

## 四、基金份额的发售与认购

### (一) 基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

#### 1、发售时间

自基金份额发售之日起，最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 2、发售方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人以现金进行的认购；网下股票认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的具体安排详见《招募说明书》的相关规定。

基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理公司的确认结果为准。

#### 3、发售对象

中国境内的个人投资者和机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### (二) 基金份额的认购

#### 1、认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率不得超过认购金额的 5%。本基金的认购费率在招募说明书和发售公告中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等基金募集期间发生的各项费用。

## 2、募集期利息与募集股票权益的处理方式

本基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。投资者现金认购款项在基金募集期间形成的利息折算成基金份额计入基金投资者的账户，募集股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

## 3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到整数位，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。

### (三) 基金份额认购及持有限额

基金管理人可以对每个账户的认购及持有基金份额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。

## 五、基金备案

### (一) 基金备案和基金合同生效

1、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于 2 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规和招募说明书的规定可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集期结束之日起 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。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。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前，基金募集期间募集的资金存入专用账户，任何人不得动用；网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。

### (二) 基金募集失败

1、基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计同期银行存款利息；对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，发售代理机构应予以解冻。

### (三) 基金存续期内的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报告，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。

## 六、基金份额折算和变更登记

### （一）基金份额折算的时间

基金合同生效后，基金管理人应逐步调整实际组合直至达到跟踪指数要求，此过程为基金建仓。基金建仓期不超过 3 个月。

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并提前公告。

### （二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算日的指数收盘值的千分之一基本一致。

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

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记结算机构遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### （三）基金份额折算的方法

对基金份额折算后的基金份额持有人持有的基金份额计算至整数位（小数部分舍去，舍去部分计入基金财产），加总得到折算后的基金总份额。基金份额折算的具体方法由《招募说明书》规定。

## 七、基金份额的交易

### （一）基金上市

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

- 1、基金募集金额(含募集股票市值)不低于2亿元；
- 2、基金份额持有人不少于1000人；
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### （三）暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本章第一款规定的上市条件；
- 2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

### （四）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 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应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金终止上市公告。

若因上述1、4项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接以中小板300价格指数为标的的指数基金。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，基金管理人将选取其他合适的指数作为标的指数，并就基金标的指数的更换提交基金份额持有人大会表决，同时报中国证监会备案并及时公告。

#### （五）基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单，深圳证券交易所在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值(IOPV)，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。参考净值的具体计算方法参见《招募说明书》。

基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。



## 八、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回场所

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

基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并在基金管理人网站公示。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构,并在基金管理人网站公示。

### (二) 申购和赎回的开放日及开放时间

#### 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《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金在基金份额折算日之后、最迟不超过基金合同生效后 3 个月内开始办理申购。若其后基金申请上市,上市期间基金可暂停办理申购。

本基金自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,由基金管理人在开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (三) 申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、不违背交易所相关规则的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请

基金投资者必须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。

基金投资者在提交申购申请时须根据申购、赎回清单备足申购对价，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和现金，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

基金投资者申购、赎回申请在 T+1 日内进行确认，不同的申购、赎回模式的确认时间可能存在差异，具体详见本基金招募说明书。

如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

基金销售机构受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。投资人可通过其办理申购、赎回业务的申购赎回代理机构或以申购赎回代理机构规定的其他方式查询有关申请的确认情况。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

##### 3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的组合证券、基金份额、现金替代、现金差额及其他对价交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则，具体规则在本基金招募说明书中列示。

如果登记结算机构在清算交收时发生清算交收参与方不能正常履约的情形，则依据深圳证券交易所、登记结算机构相关业务规则和参与各方相关协议的有关

规定进行处理。

在法律法规允许的范围内，基金管理人在不损害基金份额持有人权益并不违背交易所和登记机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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

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

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (五) 申购和赎回的数额限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整，具体规定请参见招募说明书。

2、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份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，基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

3、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整对申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### (六) 申购、赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现

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

2、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照一定的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用，具体规定请参见《招募说明书》。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购、赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

#### （七）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情形时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易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、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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 4、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购；
- 5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 6、基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

#### （八）暂停赎回的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；

2、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

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，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对价款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

4、深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理赎回；

5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停赎回情形之一时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停赎回公告。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予以公告。

#### （九）基金的转托管、非交易过户等其他业务

登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

## 九、基金认购、申购和赎回等业务的代理

本基金的认购、申购、赎回等业务可由基金管理人及基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回等业务的，应与其签订书面委托代理协议，以明确双方的权利和义务。

基金管理人和代销机构应严格按照法律法规和本基金合同的规定办理本基金的认购、申购和赎回等业务。

## 十、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：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-49848（集中办公区）

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

法定代表人：孙树明

成立时间：2003 年 8 月 5 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[2003]91 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.2688 亿元

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费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(3) 依据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 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；

- (7) 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；
- (8) 根据基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (9) 自行承担基金登记结算机构或选择、更换登记结算机构，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 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；
- (11) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (12) 依法召集基金份额持有人大会；
- (13) 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；
- (14) 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；
- (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (16) 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、赎回和登记结算事宜；
- (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) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格以及申购、赎回对价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、足额支付投资者申购的基金份额或赎回的对价；
- (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、中期和年度基金报告；
- (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：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

### 2、基金托管人的权利

- (1) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同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，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；
- (6) 依法提议召开或召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

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

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；

(10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回对价；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

- (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交付赎回对价；
- (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) 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；
- (18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，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；
- (19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；
- (20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (21) 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中国银监会，并通知基金管理人；
- (22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (23) 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；
- (24) 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。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(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、申购对价及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

(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其他基金份额持有人合法权益的活动；

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(6) 遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；

(7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(8) 法律法规和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。

## 十一、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时,联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为:在本基金基金份额持有人大会的权益登记日,联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例,计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的,须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会,联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的,由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

### (二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(“以上”含本数,下同)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) 终止基金合同;

(2) 转换基金运作方式;

(3) 变更基金类别;

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；
- (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、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- (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、调低赎回费率或变更收费方式；
- (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发生变化；
- (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。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上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。

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。

#### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 日在指定媒体网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；



(10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(五) 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，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

(2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

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

#### (六) 议事内容与程序

##### 1、 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会

上进行解释和说明。

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

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### (1)现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的

表决截止日期第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(七)决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1)一般决议

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

(2)特别决议

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

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

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

(八)计票

1、现场开会

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

召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

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

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体公告。

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) 法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 十二、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一) 基金管理人的更换

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- (1) 基金管理人被依法取消其基金管理资格的；
- (2) 基金管理人解散、依法撤销或依法宣告破产；
- (3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2、基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或者由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3) 核准：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，更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：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，新任基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金财产；

(5) 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；审计费用在基金财产中列支；

(6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告；

(7) 基金名称变更：基金管理人退任后，应原任基金管理人要求，本基金应替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

## (二) 基金托管人的更换

### 1、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1) 基金托管人被依法取消其基金托管资格的；
- (2) 基金托管人解散、依法撤销或依法宣布破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 2、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或者由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名；

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

(3) 核准：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，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：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，及时与新任基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金财产；

(5) 审计：基金托管人职责终止的，应当按照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；审计费用从基金财产中列支；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒体上公告。

## (三) 基金管理人与基金托管人同时更换

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应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获得中国证监会核准后依照有关规定在指定媒

体上联合公告。

（四）新基金管理人接受基金管理业务或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。



### 十三、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

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。

## 十四、基金份额的登记结算

(一) 登记结算业务是指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记和结算业务。基金管理人应与登记结算机构签订委托代理协议，以明确双方的权利和义务，保护投资者和基金份额持有人的合法权益。

(二) 本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

(三) 登记结算机构享有如下权利：

- 1、建立和管理基金投资者基金份额账户；
- 2、取得登记结算费；
- 3、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；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记结算业务的办理时间进行调整，并依照有关规定在指定媒体上公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

(四) 登记结算机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 2、严格按照法律法规、基金合同及登记结算机构业务规则规定的条件办理基金的登记结算业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以上；
- 4、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造成的损失，须承担相应的赔偿责任，但监管部门和司法强制检查情形除外；
- 5、按基金合同和招募说明书规定以及登记结算机构业务规则为投资者办理非交易过户业务、转托管和提供其他必要服务；
- 6、法律法规规定的其他义务。

## 十五、基金的投资

### (一) 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

### (二) 投资理念

中国经济和资本市场的长期发展，推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念，以较低的成本和较低的风险获得中小板市场平均水平的长期回报。

### (三) 投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股和备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

### (四) 投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。

一般情形下，本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑行业属性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

在法律法规允许的情况下，基金管理人在履行相应程序后可以使用相关金融

衍生工具，以更好地实现基金的投资目标。但基金管理人使用相关金融衍生工具必须是以提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差等为目的，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

### 1、投资决策依据

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

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

### 3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

(1) 研究：数量投资部依托公司整体研究平台，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、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，并撰写相关的研究报告，作为本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数量投资部提供的研究报告，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，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。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，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数的变动，结合成份股基本

面情况、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等，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程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

#### （五）投资组合管理

##### 1、投资组合的构建

本基金投资组合的构建主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略、组合调整。

（1）确定目标组合：基金管理人主要采用完全复制标的指数成份股的构成及权重的方法确定目标组合；

（2）制定建仓策略：基金经理根据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素的分析，制定合理的建仓策略；

（3）组合调整：基金经理在规定的时间内，采用适当的方法和措施对组合进行调整，直至达到紧密跟踪标的指数的要求。

##### 2、投资组合的日常管理

（1）标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为信息以及成份股公司其他重大信息，包括但不限于成份股发生配股、增发、分红、停牌、复牌等，分析这些信息对指数的影响，并进行相应的组合调整分析，为投资决策提供依据。

（2）标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数的调整等变化，确定标的指数变化是否与预期一致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

（3）每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪基金申购和赎回情况，分析其对投资组合的影响。

（4）组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理跟踪分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并对拟调整的成份股进行流动性分析。

（5）组合调整：找出将实际组合调整为目标组合的最优方案，确定组合交易计划；如发生标的指数成份股调整、成份股公司发生并购重组等重大事项，基金经理召集会议，决定基金的操作策略；调整组合，达到目标组合的持仓结构。

(6) 每日申购赎回清单的制作：基金经理以 T-1 日指数成份股的构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，制作 T 日的申购赎回清单并公告。

### 3、投资组合的定期管理

#### (1) 每月

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中的现金比例，进行支付现金的准备。

每月末，基金经理对投资操作、投资组合表现、跟踪误差等进行分析，分析最近投资组合与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

#### (2) 每半年

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在标的指数成份股调整生效前，分析并制定投资组合调整策略，尽量减少因成份股变动带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

### 4、投资绩效评估

(1) 每日对基金的跟踪偏离度进行分析；

(2) 每月末对本基金的运行情况进行量化评估；

(3) 每月末根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的跟踪误差和跟踪偏离度的产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时，基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

#### (六) 标的指数和业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为中小板 300 价格指数。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数

不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。

#### (七) 风险收益特征

本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中小板 300 价格指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### (八) 投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

2、本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%；

3、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

4、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；

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、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。

除第4、5项规定外，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受

上述规定限制。

#### (九) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (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) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (十一) 基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。



## 十六、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、基金应收申购款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、申购赎回代理券商和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人、申购赎回代理券商和登记结算机构的固有财产，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、申购赎回代理券商和登记结算机构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、申购赎回代理券商和登记结算机构因依法解散、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。

## 十七、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常交易日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

##### （1）上市股票的估值：

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

##### （2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

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

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）-（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理

人认为按本项第（1）-（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日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估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）-（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）-（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管

人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以双方认可的形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。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。

#### (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值

的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术不能预见、不能避免、不能克服，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，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际

损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，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，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

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

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差

错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

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

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

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

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

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

#### (七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障

基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

4、如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5、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一致的，基金管理人应当暂停估值；

6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十八、基金的费用与税收

### （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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金的指数使用许可费；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金财产拨划支付的银行费用；
- 10、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

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

### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管

费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

### 3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金,需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数使用许可费。

基金的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

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

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

1) 就每个计费季度而言,如当季度日均基金资产净值大于 5000 万元的,当季指数使用许可费下限为 3.5 万元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

2) 就每个计费季度而言,如当季度日均基金资产净值小于或者等于 5000 万元的,不设指数使用许可费下限。

指数使用许可费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计,按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于下一个季度开始后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数供应商根据相应指数使用许可协议变更指数使用许可费的计算方法、费率等,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。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。

4、上述(一)中 3 到 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

#### (四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基

金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 十九、基金的收益与分配

### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；

3、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

4、若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

5、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

6、法律法规或监管机构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应载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配原则、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

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

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作

日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定),基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(六) 收益分配中发生的费用

基金收益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。

## 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，如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 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、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业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同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 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”或“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。指定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。指定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务。

(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销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人或者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。

(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；发生其他变更的，基金管理人至少每年更新一次基金招募说明书。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(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。

(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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、



《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；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。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效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、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并至少提前 3 个工作日将基金份额折算日公告登载于指定媒体及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将在 3 个工作日内将基金份额折算结果公告登载于指定媒体上。

## 5、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和基金管理人网站上公告。

## 6、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三个工作日前将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

## 7、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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站上披露一次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、基金销售机构的网站或营业网点，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基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 8、申购、赎回清单

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

#### 9、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，并将年度报告正文登载于指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告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二个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告正文登载在指定网站上，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，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 2 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。

基金管理人应当在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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，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) 终止《基金合同》、基金清算；
- (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；
- (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、变更公司的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人高级管理人员、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；
- (11) 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；
- (12) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (13) 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；
- (14) 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情形除外；
- (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) 基金更换登记结算机构；
- (20) 本基金开始办理申购、赎回；
- (21) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (22) 本基金暂停接受申购、赎回申请；
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(24) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(25) 基金推出新业务或服务；

(26) 基金变更标的指数；

(27) 调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(28) 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。

#### 11、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，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。

#### 12、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

13、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。

#### 14、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规的规定。

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、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。

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。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。

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。

#### (七) 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和基金上市交易的证券交易所网站，供社会公众查阅、复制。

## 二十二、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，下列涉及到基金合同变更的事项应当召开基金份额持有人大会，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：

- (1) 转换基金运作方式；
- (2) 变更基金类别；
- (3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (4) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 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；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；
- (9) 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；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (3) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；
- (4) 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；
- (5) 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，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

## (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

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

#### 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。



## 二十三、违约责任

(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反本基金合同约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的,当事人可以免责:

1、不可抗力;

2、基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

(二)基金合同当事人违反基金合同,给其他当事人造成经济损失的,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,基金合同能继续履行的,应当继续履行。

(三)本基金合同当事一方违约后,其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)因当事人之一违约而导致其他当事人损失的,基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

(五)由于不可抗力,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,由此造成基金财产或基金投资者损失,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。

## 二十四、争议的处理

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

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 二十五、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。

(一) 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。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批准并公告之日止。

(二) 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。

(三) 本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四) 本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十六、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

## 二十七、基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (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、申购对价及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- (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其他基金份额持有人合法权益的活动；

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(6) 遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；

(7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(8) 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费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(3) 依据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 根据本基金合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(9) 自行承担基金登记结算机构或选择、更换登记结算机构，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 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；

- (11) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (12) 依法召集基金份额持有人大会；
- (13) 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；
- (14) 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；
- (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (16) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；
- (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) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格以及申购、赎回对价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、足额支付投资者申购

的基金份额或赎回的对价；

(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、中期和年度基金报告；

(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。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

- (1) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同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，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

- (6) 依法提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册；
- (8) 法律法规规定的其他权利。

#### 2、基金托管人的义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定

外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

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

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；

(10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回对价；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(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交付赎回对价；

(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) 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；

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，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；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 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中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 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；

(24) 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。

(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召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

### (二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（“以上”含本数，下同）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) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(5)变更基金份额持有人大会议事程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；

(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、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(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、调低赎回费率或变更收费方式；

(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发生变化；

(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。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上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。

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。

#### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 日在指定媒体网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；

- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### (五) 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，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

##### 2、召开基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

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

通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

## (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

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

## (六) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交

大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### (1)现场开会

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

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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



## (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 一般决议

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

### (2) 特别决议

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

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

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## (八) 计票

### 1、现场开会

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

人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

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

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体公告。

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)法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### (一)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配。基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》;

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次;

3、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

4、若基金合同生效不满 3 个月,可不进行收益分配;

5、本基金的收益分配采取现金分红的方式;

6、法律法规或监管机构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应载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配原则、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

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

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定),基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### (四)收益分配中发生的费用

基金收益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。

#### 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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金的指数使用许可费；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金财产划拨支付的银行费用；
- 10、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

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

##### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

###### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、基金的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数使用许可费。

基金的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

1) 就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值大于 5000 万元的，当季指数使用许可费下限为 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

2) 就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值小于或者等于 5000 万元的，不设指数使用许可费下限。

指数使用许可费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于下一个季度开始后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数供应商根据相应指数使用许可协议变更指数使用许可费的计算方法、费率等，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用许可费。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。

4、上述(一)中 3 到 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### (四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

### 五、基金资产的投资范围和投资限制

#### (一)投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股和备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

#### (二)投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1、本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

2、本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%;

3、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

4、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;

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、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。

除第 4、5 项规定外，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

### (三) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (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) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 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资产总值减去基金负债后的价值。

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上。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### (一) 基金合同的变更

1、按照法律法规或本基金合同的规定，下列涉及到基金合同变更的事项应当召开基金份额持有人大会，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：

- (1) 转换基金运作方式；
- (2) 变更基金类别；
- (3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (4) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 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；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；
- (9) 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；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (3) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系；



(4) 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；  
(5) 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，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

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

## (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

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

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。

## 八、争议解决方式

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

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 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，供基金投资者在基金管理人、基金托管人办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

本页无正文，为《广发中小板300交易型开放式证券投资基金基金合同》签字页。

《基金合同》当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日

基金管理人：广发基金管理有限公司（章）

法定代表人或授权代表：（签字）

基金托管人：中国农业银行股份有限公司（章）

法定代表人或授权代表：（签字）

签订地点：中国北京

签订日： 年 月 日