

# 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金 上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2011 年 8 月 10 日

公告日期：2011 年 8 月 5 日

## 目录

一、	重要声明与提示 .....	1
二、	基金概览 .....	1
三、	基金的募集与上市交易 .....	5
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	8
五、	基金主要当事人简介 .....	9
六、	基金合同摘要 .....	13
七、	基金财务状况 .....	13
八、	基金投资组合 .....	14
九、	重大事件揭示 .....	17
十、	基金管理人承诺 .....	17
十一、	基金托管人承诺 .....	17
十二、	基金份额申购、赎回 .....	17
十三、	备查文件目录 .....	31
附件：	基金合同摘要 .....	32

## 一、 重要声明与提示

《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人广发基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅 2011 年 4 月 27 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及广发基金管理有限公司网站([www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn))上公告的《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》。

## 二、 基金概览

- 1、基金二级市场交易简称: 中小300
- 2、二级市场交易代码: 159907
- 3、基金申购赎回简称: 中小300
- 4、申购赎回代码: 159907
- 5、标的指数简称: 中小板300价格指数
- 6、标的指数代码: 399008
- 7、2011年8月3日基金份额总额: 652,598,847.00份
- 8、2011年8月3日基金份额净值: 1.0940元
- 9、本次上市交易份额: 652,598,847.00份
- 10、上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所
- 11、上市交易日期: 2011年8月10日
- 12、基金管理人: 广发基金管理有限公司
- 13、基金托管人: 中国农业银行股份有限公司
- 14、申购赎回代理券商:

(1) 广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

公司网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(2) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客户服务电话：4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(3) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客户服务电话：95523或4008895523

电话委托电话：021-962505

公司网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

(4) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(5) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

电话：0871-3577398

传真：0871-3578827

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

(6) 中航证券有限公司

住所：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-6768681

传真：0791-6770178

公司网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(7) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人：陈林

联系人：陈康菲

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

公司网站：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(8) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：济南市经七路86号证券大厦

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

公司网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(9) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

(10) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

(11) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

(12) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务电话：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(13) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务热线：400-8888-123

公司网址：www.xyzq.com.cn

（14）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务热线：95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

（15）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：400-800-8899

公司网站：www.cindasc.com

（16）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618

公司网址：www.i618.com.cn

### 三、 基金的募集与上市交易

#### （一）本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2011年3月21日证监许可[2011]424号。

2、基金合同生效日：2011年6月3日。

3、基金运作方式：交易型开放式。

4、基金合同期限：不定期。

5、发售日期：2011年5月3日至2011年5月27日。其中，网下现金认购和网上现金认购的日期为2011年5月3日至2011年5月27日，网下股票认购的日期为2011年5月23日至2011年5月27日。

6、发售价格：人民币1.00元。

7、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。

8、发售机构：

(1) 网下现金发售直销机构

广发基金管理有限公司

(2) 网上现金发售代理机构

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理：广发证券、国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、华泰联合证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国证券、中信万通证券、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福证券、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券等（排序不分先后）。

(3) 网下股票发售代理机构为以下机构

广发证券、广发华福证券、兴业证券、申银万国证券、国泰君安证券、银河证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、华泰联合证券、东北证券、东方证券、平安证券、渤海证券、海通证券、金元证券、光大证券、东海证券、国盛证券、山西证券、湘财证券、国联证券、广州证券、中信证券、德邦证券、华安证券、中信金通证券、中原证券、国都证券、安信证券、中航证券、长江证券、齐鲁证券、江海证券、华宝证券、华龙证券、信达证券、厦门证券、南京证券、华融证券、浙商证券、西南证券、国金证券、财通证券、东吴证券、方正证券、国海证券、国元证券、华泰证券、民族证券、万联证券、中投证券、中信万通证券、长城证券等（排序不分先后）。

9、验资机构名称：德勤华永会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况

本基金于 2011 年 5 月 3 日起公开募集，基金募集工作已于 2011 年 5 月 27 日顺利结束。

经德勤华永会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 718,238,734.00 元人民币（含募集股票市值），折合基金份额 718,238,734.00 份。认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 59,530.17 元人民币。募集资金已于 2011 年 6 月 2 日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 9,412 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 718,294,002.00 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中，广发基金管理有限公司及本基金管理人基金从业人员未认购本基金。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2011 年 6 月 3 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）本基金份额折算

根据《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《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》的有关规定，广发基金管理有限公司确定 2011 年 7 月 25 日为广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与 2011 年 7 月 25 日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011 年 7 月 25 日，中小板 300 价格指数收盘值为 1078.962 点，本基金的基金资产净值为 704,134,532.97 元，折算前基金份额总额为 718,294,002.00 份，折算前基金份额净值为 0.9803 元。

根据《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》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.90854670（以四舍五入的方法保留到小数点后 8 位），折算后基金份额总额为 652,598,847.00 份，折算后基金份额净值为 1.0790 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于 2011 年 7 月 26 日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位（小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产）。投资者可以自 2011 年 7 月 27 日起在销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（三）本基金上市交易的主要内容

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上[2011]236号
- 2、上市交易日期：2011年8月10日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、基金二级市场交易简称：中小300
- 5、二级市场交易代码：159907

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易

- 6、本次上市交易份额：652,598,847.00份

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

#### 四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一）持有人户数

截至2011年8月3日，本基金份额持有人户数为9,412户，平均每户持有的基金份额为69,336.89份。

##### （二）持有人结构

截至2011年8月3日，本基金份额持有人结构如下：

个人投资者持有的基金份额为346,150,635份，占基金总份额的53.04%；机构投资者持有的基金份额为306,448,212份，占基金总份额的46.96%。

##### （三）截至2011年8月3日，前十名基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例（%）
1	广发证券—工行—广发金管家新型高成长集合资产管理计划	45,431,120.00	6.96%
2	红塔证券股份有限公司	27,258,292.00	4.18%
3	中航—浦发—中航金航2号集合资产管理计划	27,257,536.00	4.18%
4	中国银河证券股份有限公司	20,000,193.00	3.06%
5	海通证券股份有限公司	18,171,922.00	2.78%
6	渤海证券股份有限公司	18,171,690.00	2.78%
7	华宝证券有限责任公司	18,171,690.00	2.78%
8	齐鲁证券-中信-金泰山灵活配置集合资产管理计划	18,171,689.00	2.78%

9	山西证券股份有限公司	13,628,768.00	2.09%
10	兴业证券股份有限公司	9,086,753.00	1.39%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

## 五、 基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：马庆泉

总经理：林传辉

注册资本：1.2 亿元人民币

注册地址：广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层

设立批准文号：中国证监会证监基字[2003]91 号

工商登记注册的法人营业执照文号：440000000011836

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例：广发证券股份有限公司、香江投资有限公司、烽火通信科技股份有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司，分别持有本基金管理人 48.33%、16.67%、16.67%、10% 和 8.33% 的股权。

#### 3、内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	决定公募基金的投资理念、投资准则；研判市场时机，审议公募基金经理提交的资产配置报告,确定公募基金资产配置比例；评估并审定公募基金投资策略及拟重点投资的证券；对委员会决议的执行情况进行监督等。
风险控制委员会	负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施等。
部门名称	职能定位
投资管理部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究发展部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
机构投资部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理

国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
数量投资部	负责公募指数型基金的管理、指数衍生产品（包括股指期货等）的研究和应用、量化选股的投资产品研究和管理
金融工程部	负责产品开发、设计、报批工作，公司发展规划研究
市场拓展部	负责公募基金、一对多专户理财产品的募集与持续销售、营销推广、客户服务工作，下设北京、上海、广州三个分公司。
机构理财部	负责企业年金、“一对一”专户理财业务、机构业务的市场开拓与服务
综合管理部	负责行政管理与后勤保障
财务部	负责公司财务管理工作
人力资源部	负责人力资源管理
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理，投资风险监控与业绩归因分析
中央交易部	负责执行基金、组合交易指令，实施一线风险监控等
信息技术部	负责公司信息化建设工作
注册登记部	负责开放式基金和资产管理计划份额的登记存管和资金的清算管理
基金会计部	负责开放式基金、年金资产和资产管理计划的核算及相关信息披露工作
北京办事处	负责协调办理公司在京有关事项。

4、截止 2011 年 6 月 30 日，广发基金管理有限公司总人数 214 人，其中博士学位 16 人、硕士学位 115 人和学士学位 68 人。

#### 5、本基金经理

陆志明先生，中国籍，经济学硕士，持有证券业执业资格证书，1999 年 5 月至 2001 年 5 月任大鹏证券有限公司研究员，2001 年 5 月至 2010 年 8 月就职于深圳证券信息有限公司，历任指数小组组长、指数部副总监、总监，2010 年 8 月至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理，2011 年 6 月 3 日起任广发中小板 300ETF 基金的基金经理，2011 年 6 月 9 日起任广发中小板 300 联接基金的基金经理。

### （二）基金托管人

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称：“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：项俊波

成立日期：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

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“金牌理财”TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 130 名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2011 年 7 月 13 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 103 只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基

金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责

任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金。

（三）验资机构

名称：德勤华永会计师事务所有限公司  
 办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼  
 法人代表：卢伯卿  
 电话：021-61418888  
 传真：021-63350003  
 经办注册会计师：胡小骏 洪锐明  
 联系人：胡小骏

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金 2011 年 8 月 3 日资产负债表如下：

资 产	2011 年 8 月 3 日	负债和所有者权益	2011 年 8 月 3 日
	余额		余额
资 产：		负债：	
银行存款	9,684,670.47	短期借款	
结算备付金	15,585,134.16	交易性金融负债	
存出保证金	6,442,701.34	衍生金融负债	
交易性金融资产	683,419,148.38	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	683,326,154.38	应付证券清算款	41,545.79
债券投资	92,994.00	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	29,236.25

基金投资		应付托管费	5,847.25
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	566,170.32
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	53,466.02	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	587,645.39
其他资产		负债合计	1,230,445.00
		所有者权益：	
		实收基金	718,294,002.00
		未分配利润	-4,339,326.63
		所有者权益合计	713,954,675.37
资产合计：	715,185,120.37	负债与持有人权益总计：	715,185,120.37

## 八、 基金投资组合

截止到 2011 年 8 月 3 日，本基金的投资组合如下：

### (一) 基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	683,326,154.38	95.55
	其中：股票	683,326,154.38	95.55
2	固定收益投资	92,994.00	0.01
	其中：债券	92,994.00	0.01
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	25,269,804.63	3.53
6	其他各项资产	6,496,167.36	0.91
7	合计	715,185,120.37	100.00

### (二) 按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,120,226.00	1.98
B	采掘业	20,434,445.72	2.86
C	制造业	459,624,907.08	64.38
C0	食品、饮料	32,419,082.51	4.54
C1	纺织、服装、皮毛	19,793,438.00	2.77
C2	木材、家具	3,372,896.00	0.47

C3	造纸、印刷	12,436,884.50	1.74
C4	石油、化学、塑胶、塑料	68,809,823.62	9.64
C5	电子	71,249,194.47	9.98
C6	金属、非金属	43,184,222.26	6.05
C7	机械、设备、仪表	133,078,933.83	18.64
C8	医药、生物制品	62,557,093.69	8.76
C99	其他制造业	12,723,338.20	1.78
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,572,300.00	0.64
E	建筑业	32,977,858.24	4.62
F	交通运输、仓储业	3,531,966.00	0.49
G	信息技术业	49,915,259.37	6.99
H	批发和零售贸易	60,958,988.84	8.54
I	金融、保险业	11,579,725.00	1.62
J	房地产业	10,793,336.38	1.51
K	社会服务业	10,486,323.75	1.47
L	传播与文化产业	3,260,782.00	0.46
M	综合类	1,070,036.00	0.15
	合计	683,326,154.38	95.71

(三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁电器	3,153,825	38,192,820.75	5.35
2	002304	洋河股份	137,959	19,272,872.30	2.70
3	002202	金风科技	948,800	12,846,752.00	1.80
4	002422	科伦药业	160,255	11,166,568.40	1.56
5	002155	辰州矿业	270,500	9,897,595.00	1.39
6	002073	软控股份	436,300	8,896,157.00	1.25
7	002142	宁波银行	832,700	8,851,601.00	1.24
8	002106	莱宝高科	278,800	7,494,144.00	1.05
9	002001	新 和 成	243,600	6,988,884.00	0.98
10	002008	大族激光	570,581	6,909,735.91	0.97

(四) 按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券		
	其中：政策性金融债		

4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债	92,994.00	0.01
8	其他		
9	合计	92,994.00	0.01

(五) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	129031	巨轮转2	750	92,994.00	0.01

(六) 投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,442,701.34
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	53,466.02
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	6,496,167.36

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金 2011 年 8 月 3 日未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金 2011 年 8 月 3 日前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 九、 重大事件揭示

以 2011 年 7 月 25 日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的“（二）本基金份额折算”。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、 基金份额申购、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，并予以公告。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，并予以公告。

目前,本基金申购赎回代理券商的名单如下:广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、中航证券有限公司、华宝证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、渤海证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、山西证券股份有限公司。若深圳证券交易所、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赎回的,本基金管理人将另行公告。

## (二) 申购与赎回的开放日及时间

### 1、申购、赎回的开始时间

自 2011 年 8 月 10 日起,本基金开始办理申购、赎回。

### 2、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。

基金上市后,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。

## (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、赎回申请在受理当日进行确认。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，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

## 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股票和基金份额交收适用深圳证券交易所的结算规则。

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在 T+1 日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《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》的有关规定进行处理。

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，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （五）申购与赎回的数额限制

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。本基金最小申购、赎回单位为 200 万份。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不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

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。

## （七）申购、赎回清单的内容与格式

### 1、申购、赎回清单的内容

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

### 2、组合证券相关内容

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

### 3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资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。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率。

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

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

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

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

#### （2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

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

对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

#### ③替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应

退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等发生的权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记结算机构，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算；T+2 日后第 2 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 22 个交易日），登记结算机构办理现金替代多退少补资金的交收。

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

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

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为 n。

### （3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除，或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

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

### 4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

T 日预估现金差额 = T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整的前收盘价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 T 日经除权调整的前收盘价乘积之和)

其中，T 日经除权调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

#### 5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购、赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额} + \text{申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和} + \text{申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与 } T \text{ 日收盘价相乘之和})$ 。

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

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

#### 6、申购、赎回清单的格式

基金管理人有权根据业务需要对申购、赎回清单的格式进行修改。

申购、赎回清单的格式举例如下：

##### 基本信息

最新公告日期：20110725

基金名称：中小 300

基金管理公司名称：广发基金管理有限公司

基金代码：159907

标的指数代码：399008

##### T-1 日 信息内容

现金差额（单位：元）：-21,669.41

最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）：2,034,201.59

基金份额净值（单位：元）：1.0171

##### T 日 信息内容

预估现金差额（单位：元）：-21,180.41

可以现金替代比例上限：45 %

是否需要公布 IOPV：是

最小申购、赎回单位（单位：份）：2,000,000

最小申购赎回单位现金红利（单位：元）：无

申购赎回组合证券只数：300 只

是否开放申购：是

是否开放赎回：是

### 组合信息内容

证券代码	证券名称	股票数量	现金替代标志	现金替代保证金率	固定替代金额
002001	新 和 成	700	允许	21%	
002003	伟星股份	300	允许	21%	
002004	华邦制药	200	允许	21%	
002005	德豪润达	500	允许	21%	
002006	精功科技	200	允许	21%	
002007	华兰生物	600	允许	21%	
002008	大族激光	1700	允许	21%	
002009	天奇股份	400	允许	21%	
002010	传化股份	500	允许	21%	
002011	盾安环境	700	允许	21%	
002012	凯恩股份	400	允许	21%	
002013	中航精机	300	允许	21%	
002014	永新股份	200	允许	21%	
002015	霞客环保	400	允许	21%	
002016	世荣兆业	300	允许	21%	
002017	东信和平	200	允许	21%	
002019	鑫富药业	300	允许	21%	
002020	京新药业	100	允许	21%	
002021	中捷股份	700	允许	21%	
002022	科华生物	900	允许	21%	
002023	海特高新	500	允许	21%	
002024	苏宁电器	9100	允许	21%	
002025	航天电器	400	允许	21%	
002027	七喜控股	300	允许	21%	
002028	思源电气	600	允许	21%	
002029	七 匹 狼	300	允许	21%	
002030	达安基因	500	允许	21%	
002031	巨轮股份	400	允许	21%	
002032	苏 泊 尔	200	允许	21%	
002033	丽江旅游	200	允许	21%	
002035	华帝股份	300	允许	21%	
002036	宜科科技	300	允许	21%	

002037	久联发展	300	允许	21%	
002038	双鹭药业	500	允许	21%	
002039	黔源电力	200	允许	21%	
002041	登海种业	300	允许	21%	
002042	华孚色纺	200	允许	21%	
002043	兔宝宝	300	允许	21%	
002045	广州国光	600	允许	21%	
002046	轴研科技	100	允许	21%	
002047	成霖股份	500	允许	21%	
002048	宁波华翔	900	允许	21%	
002049	晶源电子	200	允许	21%	
002050	三花股份	200	允许	21%	
002051	中工国际	300	允许	21%	
002052	同洲电子	500	允许	21%	
002053	云南盐化	200	允许	21%	
002054	德美化工	300	允许	21%	
002055	得润电子	200	允许	21%	
002056	横店东磁	400	允许	21%	
002057	中钢天源	100	允许	21%	
002060	粤水电	500	允许	21%	
002061	江山化工	200	允许	21%	
002062	宏润建设	300	允许	21%	
002063	远光软件	400	允许	21%	
002064	华峰氨纶	800	允许	21%	
002065	东华软件	500	允许	21%	
002066	瑞泰科技	100	允许	21%	
002067	景兴纸业	700	允许	21%	
002068	黑猫股份	300	允许	21%	
002069	獐子岛	500	允许	21%	
002071	江苏宏宝	200	允许	21%	
002073	软控股份	1300	允许	21%	
002074	东源电器	400	允许	21%	
002076	雪莱特	200	允许	21%	
002077	大港股份	300	允许	21%	
002078	太阳纸业	700	允许	21%	
002079	苏州固锔	300	允许	21%	
002080	中材科技	300	允许	21%	
002081	金螳螂	400	允许	21%	
002082	栋梁新材	300	允许	21%	
002083	孚日股份	1000	允许	21%	
002084	海鸥卫浴	300	允许	21%	
002085	万丰奥威	300	允许	21%	
002086	东方海洋	400	允许	21%	

002087	新野纺织	800	允许	21%	
002088	鲁阳股份	300	允许	21%	
002089	新海宜	500	允许	21%	
002090	金智科技	200	允许	21%	
002091	江苏国泰	400	允许	21%	
002092	中泰化学	1600	允许	21%	
002093	国脉科技	300	允许	21%	
002094	青岛金王	400	允许	21%	
002095	生意宝	100	允许	21%	
002096	南岭民爆	100	允许	21%	
002097	山河智能	600	允许	21%	
002098	浔兴股份	100	允许	21%	
002099	海翔药业	200	允许	21%	
002100	天康生物	200	允许	21%	
002101	广东鸿图	100	允许	21%	
002104	恒宝股份	600	允许	21%	
002105	信隆实业	300	允许	21%	
002106	莱宝高科	800	允许	21%	
002108	沧州明珠	300	允许	21%	
002109	兴化股份	500	允许	21%	
002110	三钢闽光	300	允许	21%	
002112	三变科技	200	允许	21%	
002114	罗平锌电	200	允许	21%	
002115	三维通信	200	允许	21%	
002117	东港股份	100	允许	21%	
002118	紫鑫药业	300	允许	21%	
002119	康强电子	300	允许	21%	
002121	科陆电子	400	允许	21%	
002122	天马股份	1200	允许	21%	
002123	荣信股份	700	允许	21%	
002124	天邦股份	200	允许	21%	
002126	银轮股份	200	允许	21%	
002127	新民科技	200	允许	21%	
002128	露天煤业	700	允许	21%	
002129	中环股份	600	允许	21%	
002130	沃尔核材	300	允许	21%	
002131	利欧股份	300	允许	21%	
002132	恒星科技	600	允许	21%	
002133	广宇集团	700	允许	21%	
002134	天津普林	300	允许	21%	
002135	东南网架	200	允许	21%	
002137	实益达	200	允许	21%	
002138	顺络电子	200	允许	21%	

002139	拓邦股份	200	允许	21%	
002140	东华科技	400	允许	21%	
002142	宁波银行	2400	允许	21%	
002146	荣盛发展	1200	允许	21%	
002147	方圆支承	300	允许	21%	
002148	北纬通信	200	允许	21%	
002149	西部材料	200	允许	21%	
002151	北斗星通	100	允许	21%	
002152	广电运通	500	允许	21%	
002153	石基信息	200	允许	21%	
002154	报喜鸟	500	允许	21%	
002155	辰州矿业	800	允许	21%	
002156	通富微电	600	允许	21%	
002157	正邦科技	500	允许	21%	
002158	汉钟精机	100	允许	21%	
002159	三特索道	200	允许	21%	
002160	常铝股份	300	允许	21%	
002161	远望谷	400	允许	21%	
002162	斯米克	400	允许	21%	
002163	中航三鑫	900	允许	21%	
002164	东力传动	200	允许	21%	
002165	红宝丽	300	允许	21%	
002166	莱茵生物	200	允许	21%	
002167	东方锆业	300	允许	21%	
002168	深圳惠程	500	允许	21%	
002169	智光电气	300	允许	21%	
002170	芭田股份	300	允许	21%	
002171	精诚铜业	300	允许	21%	
002172	澳洋科技	500	允许	21%	
002176	江特电机	300	允许	21%	
002177	御银股份	400	允许	21%	
002179	中航光电	300	允许	21%	
002181	粤传媒	500	允许	21%	
002182	云海金属	400	允许	21%	
002183	怡亚通	700	允许	21%	
002184	海得控制	200	允许	21%	
002185	华天科技	500	允许	21%	
002186	全聚德	100	允许	21%	
002187	广百股份	200	允许	21%	
002189	利达光电	200	允许	21%	
002190	成飞集成	100	允许	21%	
002191	劲嘉股份	500	允许	21%	
002192	路翔股份	100	允许	21%	

002193	山东如意	200	允许	21%	
002194	武汉凡谷	300	允许	21%	
002197	证通电子	200	允许	21%	
002202	金风科技	2800	允许	21%	
002203	海亮股份	200	允许	21%	
002204	华锐铸钢	100	允许	21%	
002205	国统股份	100	允许	21%	
002206	海利得	300	允许	21%	
002208	合肥城建	300	允许	21%	
002209	达意隆	200	允许	21%	
002210	飞马国际	200	允许	21%	
002211	宏达新材	300	允许	21%	
002213	特尔佳	200	允许	21%	
002214	大立科技	100	允许	21%	
002215	诺普信	300	允许	21%	
002216	三全食品	100	允许	21%	
002217	联合化工	400	允许	21%	
002218	拓日新能	300	允许	21%	
002219	独一味	300	允许	21%	
002220	天宝股份	200	允许	21%	
002221	东华能源	200	允许	21%	
002222	福晶科技	400	允许	21%	
002223	鱼跃医疗	300	允许	21%	
002225	濮耐股份	300	允许	21%	
002226	江南化工	100	允许	21%	
002230	科大讯飞	300	允许	21%	
002232	启明信息	400	允许	21%	
002233	塔牌集团	600	允许	21%	
002236	大华股份	200	允许	21%	
002237	恒邦股份	200	允许	21%	
002238	天威视讯	200	允许	21%	
002240	威华股份	500	允许	21%	
002241	歌尔声学	500	允许	21%	
002242	九阳股份	500	允许	21%	
002243	通产丽星	200	允许	21%	
002244	滨江集团	800	允许	21%	
002248	华东数控	200	允许	21%	
002249	大洋电机	400	允许	21%	
002250	联化科技	300	允许	21%	
002251	步步高	200	允许	21%	
002252	上海莱士	200	允许	21%	
002253	川大智胜	100	允许	21%	
002254	烟台氨纶	500	允许	21%	

002255	海陆重工	200	允许	21%	
002259	升达林业	300	允许	21%	
002261	拓维信息	200	允许	21%	
002262	恩华药业	200	允许	21%	
002263	大东南	500	允许	21%	
002264	新华都	100	允许	21%	
002266	浙富股份	300	允许	21%	
002267	陕天然气	200	允许	21%	
002268	卫士通	200	允许	21%	
002269	美邦服饰	200	允许	21%	
002271	东方雨虹	300	允许	21%	
002273	水晶光电	100	允许	21%	
002274	华昌化工	200	允许	21%	
002275	桂林三金	300	允许	21%	
002276	万马电缆	300	允许	21%	
002277	友阿股份	500	允许	21%	
002278	神开股份	300	允许	21%	
002281	光迅科技	100	允许	21%	
002283	天润曲轴	500	允许	21%	
002284	亚太股份	200	允许	21%	
002285	世联地产	200	允许	21%	
002290	禾盛新材	100	允许	21%	
002291	星期六	200	允许	21%	
002292	奥飞动漫	200	允许	21%	
002293	罗莱家纺	100	允许	21%	
002294	信立泰	200	允许	21%	
002296	辉煌科技	100	允许	21%	
002297	博云新材	300	允许	21%	
002299	圣农发展	600	允许	21%	
002300	太阳电缆	300	允许	21%	
002302	西部建设	200	允许	21%	
002303	美盈森	100	允许	21%	
002304	洋河股份	400	允许	21%	
002306	湘鄂情	200	允许	21%	
002307	北新路桥	200	允许	21%	
002308	威创股份	400	允许	21%	
002309	中利科技	200	允许	21%	
002310	东方园林	100	允许	21%	
002311	海大集团	300	允许	21%	
002313	日海通讯	100	允许	21%	
002314	雅致股份	200	允许	21%	
002315	焦点科技	100	允许	21%	
002317	众生药业	100	允许	21%	

002318	久立特材	100	允许	21%	
002320	海峡股份	200	允许	21%	
002321	华英农业	100	允许	21%	
002322	理工监测	100	允许	21%	
002324	普利特	200	允许	21%	
002325	洪涛股份	200	允许	21%	
002326	永太科技	200	允许	21%	
002328	新朋股份	200	允许	21%	
002332	仙琚制药	400	允许	21%	
002334	英威腾	100	允许	21%	
002336	人人乐	200	允许	21%	
002340	格林美	200	允许	21%	
002342	巨力索具	200	允许	21%	
002344	海宁皮城	300	允许	21%	
002345	潮宏基	200	允许	21%	
002353	杰瑞股份	200	允许	21%	
002362	汉王科技	200	允许	21%	
002375	亚厦股份	300	允许	21%	
002378	章源钨业	200	允许	21%	
002383	合众思壮	100	允许	21%	
002384	东山精密	100	允许	21%	
002385	大北农	400	允许	21%	
002386	天原集团	300	允许	21%	
002391	长青股份	100	允许	21%	
002393	力生制药	200	允许	21%	
002399	海普瑞	200	允许	21%	
002405	四维图新	400	允许	21%	
002407	多氟多	200	允许	21%	
002408	齐翔腾达	400	允许	21%	
002410	广联达	200	允许	21%	
002414	高德红外	200	允许	21%	
002415	海康威视	300	允许	21%	
002416	爱施德	200	允许	21%	
002419	天虹商场	200	允许	21%	
002422	科伦药业	500	允许	21%	
002424	贵州百灵	300	允许	21%	
002428	云南锗业	100	允许	21%	
002429	兆驰股份	400	允许	21%	
002430	杭氧股份	300	允许	21%	
002431	棕榈园林	300	允许	21%	
002437	誉衡药业	200	允许	21%	
002440	闰土股份	200	允许	21%	
002444	巨星科技	300	允许	21%	

002449	国星光电	100	允许	21%	
002465	海格通信	200	允许	21%	
002475	立讯精密	200	允许	21%	
002479	富春环保	200	允许	21%	
002480	新筑股份	200	允许	21%	
002482	广田股份	200	允许	21%	
002493	荣盛石化	300	允许	21%	
002498	汉缆股份	200	允许	21%	
002500	山西证券	900	允许	21%	
002506	超日太阳	300	允许	21%	

#### (八) 拒绝或暂停申购的情形及处理

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、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；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，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。

#### (九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

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、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；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、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。

#### (十) 基金的转托管和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。

(十一) 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。

### 十三、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会批准广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

广发基金管理有限公司

二〇一一年八月五日

**附件：广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要**

**一、基金合同当事人**

**(一)基金管理人**

名称：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层

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

邮政编码：510308

法定代表人：马庆泉

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 1.2 亿元

存续期间：持续经营

**(二)基金托管人**

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：项俊波

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

**(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。

**二、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規规定的行为，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規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規，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，在法律法規允许的前提下，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) 法律法規规定的其他权利。

## 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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；
- (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、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。

### 三、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。

## 四、基金收益分配原则、执行方式

### (一) 基金收益分配原则

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。基金管理人根据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，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

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) 基金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。

**五、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：

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

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：

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

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：

(1) 当  $E \leq 350$  亿元时：

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

(2) 当  $E > 350$  亿元时：

$$H = 350 \text{ 亿元} \times 0.03\% \div \text{当年天数} + (E - 350 \text{ 亿元}) \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

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

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 7.5 万元，即不足 7.5 万元时按照 7.5 万元收取。

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。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。

#### (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。

### 六、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、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、向他人贷款或者提供担保；

- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

### 七、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。

### 八、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。

## 九、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。

## 十、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。