

国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 双力 A 份额与双力 B 份额上市交易公告书

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2012 年 4 月 16 日

公告日期：2012 年 4 月 11 日

目 录

一、重要声明与提示.....	2
二、基金概览	3
三、基金份额的募集与上市交易	6
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	9
五、基金主要当事人简介	10
六、基金合同摘要	16
七、基金财务状况	50
八、基金投资组合	52
九、重大事件揭示	54
十、基金管理人承诺.....	55
十一、基金托管人承诺	56
十二、基金上市推荐人意见	57
十三、备查文件目录.....	58

一、重要声明与提示

《国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A份额与双力B份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”或“本基金上市交易公告书”）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>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书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。

本基金托管人保证本报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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、深圳证券交易所对国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A份额与双力B份额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。

凡本基金上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅分别在2012年2月15日登载于《中国证券报》和国联安基金管理有限公司网站（www.vip-funds.com或www.gtja-allianz.com）、在2012年2月16日登载于《上海证券报》的《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

基金简称：国联安双力中小板综指；场内简称：国安双力；基金代码：162510

基金简称：国联安双力 A 中小板综指；场内简称：双力 A；交易代码：150069

基金简称：国联安双力 B 中小板综指；场内简称：双力 B；交易代码：150070

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

本基金的分级运作期指国联安双力中小板综指份额、国联安双力 A 中小板综指份额、国联安双力 B 中小板综指份额的共同运作期，具体为自国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）生效之日起至三年期末对应日（即分级运作期到期日），如该对应日为非工作日，则顺延到下一个工作日。如果分级运作期到期日前十五个工作日内本基金触发不定期折算条件，则本基金将提前依据基金合同约定转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF），基金管理人将决定触发不定期折算条件之日后三个工作日内的某工作日为分级运作期到期日，具体的分级运作期到期日见基金管理人届时发布的公告。依据基金合同的约定，基金在分级运作期到期自动转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF），并将继续在深圳证券交易所上市交易。

4、国联安双力中小板综指分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额包括国联安双力中小板综指分级证券投资基金之基础份额（简称“国安双力”）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力 A 份额（简称“双力 A”）与国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力 B 份额（简称“双力 B”）。其中，双力 A、双力 B 的基金份额配比始终保持 1：1 的比率不变。

5、本基金的存续期限：不定期。

6、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为国安双力份额；场内认购的全部份额将按照 1:1 的比例确认为双力 A 份额与双力 B 份额。本基金基金合同生效后，国安双力份额设置单独的基金代码，只接受场外与场内申购和赎回；双力 A 份额、双力 B 份额交易代码不同，只上市交易，不接受申购和赎回。

7、国安双力份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对国安

双力份额进行申购与赎回。国安双力份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理国安双力份额场外申购、赎回业务。国安双力份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理国安双力份额场内申购、赎回业务。双力 A 与双力 B 将不接受投资者的申购与赎回。

8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的国安双力份额与双力 A 份额、双力 B 份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每两份国安双力份额的场内份额申请转换成一份双力 A 份额与一份双力 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的一份双力 A 份额与一份双力 B 份额进行配对申请转换成两份国安双力份额的场内份额的行为。份额配对转换自双力 A 份额、双力 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，有关份额配对转换的具体规定敬请参见本基金招募说明书以及最新的相关公告。

9、定期份额折算：在分级运作期的开始两年，自基金合同生效日始每满一年的最后工作日为基金份额定期折算日。在基金份额定期折算日实施的基金份额折算为基金份额定期折算。一旦基金份额发生不定期折算，则不安排后续的定期折算。双力 A 份额和双力 B 份额按照《基金合同》规定的参考净值计算规则进行参考净值计算，折算后双力 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算日折算前双力 A 份额的基金参考份额净值超出 1.000 元的部分将折算为双力中小板份额的场内份额分配给双力 A 份额持有人。双力中小板份额持有人持有的每两份双力中小板份额将按一份双力 A 份额获得新增双力中小板份额的分配，经过上述份额折算后，双力中小板份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定敬请参见本基金招募说明书以及最新的相关公告。

10、不定期份额折算：在分级运作期内一旦某个工作日双力 B 的份额参考净值小于或等于 0.250 元，基金管理人将根据本基金《基金合同》的规定对本基金基金份额进行不定期折算，即双力 B 份额持有人持有的双力 B 份额数按照双力 B 份额的折算比例相应缩减。为保持双力 A 份额和双力 B 份额数比率 1:1 不变，双力 A 份额的折算比例与双力 B 份额的折算比例相同，双力 A 份额持有人持有的

双力 A 份额数同比例相应缩减,超出部分的份额数将全部折算成双力中小板份额的场内份额。双力 A、双力 B 份额折算后的参考净值和双力中小板份额折算后净值调整为 1 元。

11、基金份额上市:本基金基金合同生效后,投资者在场内认购的全部国安双力份额将按照 1:1 的比例自动分拆为双力 A 份额与双力 B 份额,双力 A 份额与双力 B 份额将同时在深圳证券交易所上市交易。在本基金分级运作期到期,本基金转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)后,将继续依据本基金基金合同的相关规定在深圳证券交易所上市与交易。

12、基金份额总额:截至 2012 年 4 月 9 日,本基金的基金份额总额为 809,109,186.27 份,其中,国安双力为 450,829,005.27 份,双力 A 为 179,140,090 份,双力 B 为 179,140,091 份。

13、基金份额净值:截止 2012 年 4 月 9 日,国安双力的基金份额净值为 1.001 元,双力 A 的基金份额参考净值为 1.003 元,双力 B 的基金份额参考净值为 0.999 元。

14、本次上市交易的基金份额简称:双力 A、双力 B

15、本次上市交易的基金份额总额:双力 A: 179,140,090 份;双力 B: 179,140,091 份

16、本次上市交易的基金份额交易代码:双力 A 为 150069;双力 B 为 150070

17、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

18、上市交易日期:2012 年 4 月 16 日

19、基金管理人:国联安基金管理有限公司

20、基金托管人:中国建设银行股份有限公司

21、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：经 2011 年 10 月 8 日中国证监会证监许可[2011]1593 号文批准募集

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：自 2012 年 2 月 20 日至 2012 年 3 月 16 日止

5、发售价格：1.00 元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构：

（1）场内发售机构

1) 直销机构：国联安基金管理有限公司。

2) 代销机构：具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（会员单位名单详见深圳证券交易所网站）。

（2）场外发售机构

1) 直销机构：国联安基金管理有限公司。

2) 代销机构：中国建设银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、国元证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中航证券有限公司、中信万通证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、江海证券有限公司、东北证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、

中国中投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华福证券有限责任公司。

8、认购费率

(1) 场外认购：本基金的认购费率按认购金额（含认购费）分档设置，并以认购金额（含认购费）为基数采用比例费率计算，最高不超过 1%。

(2) 场内认购：采用场内认购方式认购本基金的，其认购费率参照本基金的场外认购费率执行。

9、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的净认购金额（不含利息）为人民币 808,948,084.30 元，确认份额（不含利息转份额）808,948,084.30 份，利息结转份额 161,101.97 份，总确认份额为 809,109,186.27 份。

上述有效净认购资金及其已结的银行利息已于 2012 年 3 月 22 日全额划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的托管专户。根据《基金合同》的约定，本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部份额确认为国安双力份额；场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为双力 A 份额和双力 B 份额。按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间募集及利息结转的基金份额共计 809,109,186.27 份国安双力份额，其中场外认购的基金份额确认为 450,829,005.27 份国安双力份额；场内认购的基金份额按 1:1 的比例确认为 179,140,090 份双力 A 份额和 179,140,091 份双力 B 份额。

11、基金备案情况

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》以及本基金《基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，于 2012 年 3 月 22 日验资完毕，2012 年 3 月 23 日向中国证监会提交了验资报告，已办理完毕基金备案手续，并于 2012 年 3 月 23 日获书面确认，本基金《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。

12、基金合同生效日：2012 年 3 月 23 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：809,109,186.27 份，其中，国安双

力为 450,829,005.27 份、双力 A 为 179,140,090 份、双力 B 为 179,140,091 份。

(二) 双力 A 与双力 B 上市交易的主要内容

1、本基金的双力 A 份额与双力 B 份额上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2012】82 号

2、上市交易日期：2012 年 4 月 16 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

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交易（具体会员名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人就不就此事项进行公告。）。

4、基金简称：国联安双力 A 中小板综指、国联安双力 B 中小板综指

场内简称：双力 A、双力 B

5、基金交易代码：双力 A 为 150069、双力 B 为 150070

6、本次上市交易份额（截止 2012 年 4 月 9 日）：双力 A 为 179,140,090 份、双力 B 为 179,140,091 份

7、基金资产净值的披露：本基金分级运作期内，在双力 A 份额、双力 B 份额上市交易后，基金管理人于每个工作日的次日通过公司网站等媒介披露该工作日的双力中小板份额基金份额净值和基金份额累计净值、双力 A 份额和双力 B 份额的基金份额参考净值或净值和基金份额累计参考净值或累计净值，并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的国安双力份额办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，可以向具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成双力 A 和双力 B，分拆后的双力 A 和双力 B 可以在深圳证券交易所场内上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）基金份额持有人户数

截止 2012 年 4 月 9 日，基金份额持有人户数：5,177 户，平均每户持有的基金份额为 156,289.20 份，其中，国安双力为 1,854 户，平均每户持有的基金份额为 243,165.59 份；双力 A 为 3,323 户，平均每户持有的基金份额为 53,909.15 份；双力 B 为 3,323 户，平均每户持有的基金份额为 53,909.15 份。

（二）基金份额持有情况

截至截止 2012 年 4 月 9 日，基金份额持有情况：机构投资者持有的本次上市交易的双力 A 与双力 B 的基金份额分别为 30,419,890 份和 30,419,890 份，分别占本次双力 A 与双力 B 上市交易基金份额比例为 16.98%；个人投资者持有的本次上市交易的双力 A 与双力 B 的基金份额分别为 148,720,200 份和 148,720,201 份，分别占本次双力 A 与双力 B 上市交易基金份额比例为 83.02%。

（三）基金份额前十名持有人情况

截止 2012 年 4 月 9 日，本次上市交易的双力 A 与双力 B 前十名持有人情况具体如下：

序号	持有人名称	持有双力 A 份 额	占双力 A 份额比	持有双力 B 份 额	占双力 B 份 额比
1	张振杰	17,500,729	9.77%	17,500,729	9.77%
2	浙商证券-农行-浙商汇金 1 号集合资产管理计划	10,000,833	5.58%	10,000,833	5.58%
3	陈峥	8,000,333	4.47%	8,000,333	4.47%
4	华宝证券有限责任公司	7,500,312	4.19%	7,500,312	4.19%
5	安树清	5,000,486	2.79%	5,000,486	2.79%
6	红塔证券股份有限公司	5,000,416	2.79%	5,000,417	2.79%
7	翟秀英	5,000,208	2.79%	5,000,208	2.79%
8	张磊	5,000,208	2.79%	5,000,208	2.79%
9	卢丙杰	3,000,124	1.67%	3,000,125	1.67%
10	翁晓冬	2,900,120	1.62%	2,900,121	1.62%
合计		68,903,769		68,903,772	

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：国联安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

法定代表人：符学东

总经理：邵杰军

成立时间：2003 年 4 月 3 日

注册资本：1.5 亿元人民币

设立批准文号：证监基金字[2003]42 号

工商登记注册的法人营业执照文号：310000400337467（市局）

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

股东及股权结构：

股东名称	持股比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
德国安联集团	49%

2、内部组织结构及职能

本基金管理人内部共设有养老金与机构理财部、电子商务部、市场发展部、北京办事处、代销部、直销部、国际业务部、产品开发部、投资组合管理部、研究部、量化投资部、债券组合部、基金交易部、专户理财部、综合管理部、财务计划部、基金事务管理部、信息技术部、监察稽核部、风险管理部、人力资源部共二十一个职能部门。

养老金与机构理财部：筹备养老金与机构理财业务；

电子商务部：负责公司网上电子平台的搭建，对高端个人客户直销业务、第三方机构合作销售业务的开展；

市场发展部：负责市场策划、电子商务、客户服务及管理的职能部门；

北京办事处：与监管部门协调沟通的部门；

代销部：负责基金代销机构的业务协调、基金产品的代销业务等工作；

直销部：负责公司机构直销业务及客户开发、管理的职能部门；

国际业务部：负责公司 QDII 业务的展开；

产品开发部：负责产品开发和业务拓展的职能部门；

投资组合管理部：基金的投资决策部门；

研究部：公司的研究支持部门，为基金投资提供决策依据；

量化投资部：负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作；

债券组合部：负责固定收益产品的投资、研究工作；

基金交易部：公司投资交易的执行部门；

专户理财部：负责专户业务的实施；

综合管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；

财务计划部：负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作；

基金事务部：负责基金会计、清算及注册登记的职能部门；

信息技术部：为公司正常运转提供信息系统支持及信息安全保障的职能部门；

监察稽核部：负责公司法务、合规管理、内部审计的职能部门；

风险管理部：投资、交易环节风险提示及控制的职能部门；

人力资源部：负责人事管理的职能部门。

3、人员情况：

截至 2012 年 3 月 31 日，公司共有正式员工 104 人。

4、信息披露负责人：陆康芸

咨询电话：021-38992888

5、基金管理业务情况简介

截至 2012 年 3 月 31 日，国联安基金管理有限公司旗下共管理 16 只基金：国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛小盘精选证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安德盛优势股票证券投资基金、国联安德盛红利股票证券投资基金、国联安德盛增利债

券证券投资基金、国联安主题驱动股票型证券投资基金、国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金、国联安信心增益债券型证券投资基金、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安货币市场证券投资基金、国联安优选行业股票型证券投资基金、国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金和国联安双力中小板综指分级证券投资基金。

6、本基金基金经理

黄志钢先生，硕士，先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司，现担任国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金经理职务。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

信息披露负责人：尹东

联系电话：010-67595003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是

中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2011年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,392.07亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高0.21和0.23个百分点。手续费及佣金净收入687.92亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行33家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011年“世界银行品牌500强”中位列第10，较去年上升3位；在美国《财富》世界500强中排名第108位，较去年上升8位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管

业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务情况简介

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

（三）基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所

注册地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法人代表：蔡廷基

经办注册会计师：王国蓓、戴丽

联系电话：021-22122888

六、基金合同摘要

（一）基金合同当事人及权利义务

1、基金管理人基本情况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

邮政编码：200121

法定代表人：符学东

成立时间：2003 年 4 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]42 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

存续期间：五十年或股东一致同意延长的其他期限

2、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（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）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定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，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关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和赎回申请；
- (8) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记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，并依据基金销售服务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) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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、双力中小板份额净值、双力 A 份额净值与参考净值、双力 B 份额净值与参考净值及国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）份额的基金份额净值、基金份额折算比例、双力 A 份额与双力 B 份额终

止运作后的份额转换比例和双力中小板份额、国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）份额的申购、赎回价格；

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

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制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）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；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(26) 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;

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

4、基金托管人基本情况

名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行)

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码: 100033

法定代表人: 王洪章

成立时间: 2004 年 9 月 17 日

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]12 号

经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期、长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间: 持续经营

5、基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的权利为:

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(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, 依法保管基金资产;

(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，对基金资产、其他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当事人的利益；

- (6) 依法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资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

6、基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (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；
- (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、双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额及国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）份额的基金份额净值、双力 A 份额、双力 B 份额的参考净值、基金份额折算比例、双力 A 份额与双力 B 份额终止运作后的份额转换比例；

- (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赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 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) 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) 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) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

7、基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (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、申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行

为依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

8、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (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) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。本基金的分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金分级运作期到期，本基金无需召开基金份额持有人大会，双力 A 份额、双力 B 份额将自动转换为场内的双力中小板份额，转换完成后，本基金将更名为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）

2、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(含 10%，下同)的基金份额持有人(本基金的分级运作期内，指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%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；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 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，但法律法规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) 分级运作期内终止双力 A 份额与双力 B 份额的运作；
- 10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 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基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对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重大变化；
- 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。

3、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(本基金的分级运作期内, 指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(本基金的分级运作期内, 指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)仍认为有必要召开的, 应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人; 基金托管人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(本基金的分级运作期内, 指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)就同一事项要求召开基金份额持有人大会, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人(本基金的分级运作期内, 指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)有权自行召集基金份额持有人大会, 但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理人、基金托管人应当配合, 不得阻碍、干扰。

4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会, 召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。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基金份额持有人权益登记日;
- 6) 代理投票的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、书面表决意见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。

5、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, 如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。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

a. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,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(本基金的分级运作期内,指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额占各自总份额 50%以上,含 50%,下同);

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

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:

a. 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;

b. 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

c. 召集人在监督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,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

d. 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(本基金的分级运作期内,指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额占各自总份额 50%以上);

e. 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理人提交的持有基金份额的凭证、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,并与注册登记机构记录相符。

6、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。

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(本基金的分级运作期内,指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人(本基金的分级运作期内,指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自 10%的基金份额持有人)提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其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。

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、持有或代表有表决权的基金份额数量、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后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

(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。

7、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(或其代理人)所持表决权的 50%以上(本基金的分级运作期内，指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额占各自总份额 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(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(本基金的分级运作期内，指单独或合并持有双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额占各自总份额三分之二以上，含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、分级运作期内终止双力 A 份额与双力 B 份额的运作、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。

8、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，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基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

9、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。

(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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10、法律法规或监管部门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

1、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。

2、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。

3、收益分配原则

(1) 分级运作期内，本基金（包括双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额）不进行收益分配。

(2) 本基金分级运作期满并转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循下列原则：

1) 场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；场内份额收益分配只采用现金红利一种方式，基金份额持有人不能自行选择；

2) 每一基金份额享有同等分配权；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的

基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配的时间和程序

（1）基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

（2）在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定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。

（四）作为基金管理人、基金托管人报酬的管理费、托管费以及与基金财产管理、运用有关的其他费用的提取、支付方式与比例

1、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）基金财产拨划支付的银行费用；

（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的开户费用、账户维护费用；

（9）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

(10) 基金上市费及年费；

(11) 标的指数使用许可费；

(12) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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

在分级运作期内，基金管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。在分级运作期到期后，基金的基金管理费调整为按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 基金合同生效后的指数使用许可费

指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付，收取标准和方法为：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H =每日应付的指数使用许可费； E =前一日本基金的资产净值

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 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

(4) 除管理费、托管费和指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关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。

4、不列入基金费用的项目

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

5、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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

6、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) 基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综指的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。

2、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约

价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金管理人自《基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

3、投资策略

本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成份股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。

（1）目标组合的构建

1) 股票的筛选

中小板综指成份股包括在深圳中小板上市交易的所有股票，本基金在抽样复制时，将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

2) 初步确定目标组合成份股和权重

采取市值优先抽样法，对筛选出来的股票，按股票的流通市值从大到小排序，初步确定目标组合的成份股和权重。

3) 目标组合成份股及权重的调整

根据初步确定的目标组合成份股及权重，按照行业分类，得到目标组合的行业权重。将目标组合的行业权重与中小板综合指数的行业权重进行比较，如果某个行业两者出现较大偏离，通过调整组合成份股及权重并优化，确定最终的目标组合的成份股及权重，使得目标组合的行业权重与中小板综合指数对应行业的权重大致吻合。

为了能够更好的跟踪中小板综合指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前 2 个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制

方法的原因。

（2）目标组合的调整

1) 组合调整原则

本基金为指数型基金, 基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时, 本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化, 对基金投资组合进行适时调整, 以保证基金净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

2) 组合调整方法

a. 组合定期调整

每季度末根据上述抽样复制方法和组合调整原则调整股票组合及个股配置比例。

b. 组合不定期调整

对投资组合进行动态跟踪, 当行业的权重与基准产生较大偏差时, 对成份股进行相应调整, 以保证跟踪误差的最小化。

根据中小板综指的编制规则, 因指数成份股新股发行、增发、送配等股权变动需要进行成份股权重调整, 分析上述事件对组合跟踪误差的影响, 并制定合理的组合调整策略。

（3）股指期货的投资

为有效控制指数的跟踪误差, 本基金在注重风险管理的前提下, 以套期保值为目的, 适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点, 通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整, 并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时, 可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距; 在本基金发生大额净赎回时, 可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本, 从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

4、标的指数与业绩比较基准

（1）标的指数

本基金股票资产的标的指数为中小板综合指数。

中小板综合指数于 2005 年 12 月 1 日正式发布, 覆盖了深圳证券交易所中小

企业板上市的全部股票，以综合反映深圳证券交易所中小企业公司的整体状况。在中国经济结构转型，工业化不断推进背景下，中小企业是整个经济体中最为活跃和创新的部分，中小板综合指数是其良好的刻度和反映，具有较好的市场认知程度和接受度。

（2）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

5、风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

6、投资限制

（1）组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 2) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- 3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- 4) 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；
- 5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- 6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

10) 基金财产参与股票发行申购,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;

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

12) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

13) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

14) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;

15) 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%;

其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

16) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%;

18) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

19) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 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；
- 9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

7、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。

8、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

1、估值日

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

2、估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

3、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

4、分级运作期内的双力 A 份额与双力 B 份额净值的计算

(1) 双力 A 份额与双力 B 份额的净值计算

本基金在《基金合同》生效后 3 年期到期日分别计算双力 A 和双力 B 的基金份额净值。

1) 双力中小板份额净值与双力 A 份额净值、双力 B 份额净值三者关系

本基金一份双力 A 份额与一份双力 B 份额构成一对份额组合,一对双力 A 份额与双力 B 份额组合的净值之和将等于两份双力中小板份额的净值。

2) 双力 A 份额的份额净值计算

双力 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率加上 3.5%。其中计算双力 A 份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

双力 A 份额的基金份额净值以上一折算日折算后的 1 元净值为基准采用约定收益率单利进行计算。

3) 双力 B 份额的份额净值计算

计算出双力 A 的份额净值后,根据双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额净值的关系,可以计算出双力 B 份额的份额净值。

假设上一折算日次日起(含该日)第 t 个自然日(即到期日),双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额的基金份额净值分别为 NAV_t 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$,上一折算日次日的一年期银行定期存款年利率为 R ,则第 t 个自然日,双力 A 份额与双力 B 份额的基金份额净值计算如下:

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 3.5\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.5 \times NAV(A)_t) / 0.5$$

4) 双力 A 份额和双力 B 份额的净值公告

双力 A 和双力 B 份额净值在计算日当天收市后计算,并在下一日内与双力中小板基金份额净值一同公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(2) 双力 A 份额与双力 B 份额的参考净值计算

本基金《基金合同》生效后至 3 年期内(不含到期日),基金管理人采用“虚拟清算”原则分别计算并公告双力 A 和双力 B 的基金份额参考净值,其中,双力 A 和双力 B 的基金份额参考净值计算日不包括双力 A 和双力 B 的到期日。基金份额参考净值是对双力 A、双力 B 基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

1) 双力中小板份额净值与双力 A 份额参考净值、双力 B 份额参考净值三者关系

本基金一份双力 A 份额与一份双力 B 份额构成一对份额组合,一对双力 A 份额与双力 B 份额组合的参考净值之和将等于两份双力中小板份额的净值。

2) 双力 A 份额的份额参考净值计算

双力 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率加上 3.5%。其中计算双力 A 份额约定收益率的一年期银行定期存款年利率指《基金合同》生效之日或上一折算日次日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

双力 A 份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或折算日折算后的 1 元参考净值为基准采用约定收益率单利进行计算。

3) 双力 B 份额的份额参考净值计算

计算出双力 A 的份额参考净值后,根据双力中小板份额净值、双力 A 份额参考净值、双力 B 份额参考净值的关系,可以计算出双力 B 份额的份额参考净值。

假设上一折算日次日或基金合同生效日起(含该日)第 t 个自然日,双力中小板份额净值、双力 A 份额与双力 B 份额的基金份额参考净值分别为 NAV_t 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$,上一折算日次日或基金合同生效日的一年期银行定期存款年利率为 R ,则第 t 个自然日,双力 A 份额与双力 B 份额的基金份额参考净

值计算如下：

$$NAV(A)_t = 1 + (R + 3.5\%) \times t / 365$$

$$NAV(B)_t = (NAV_t - 0.5 \times NAV(A)_t) / 0.5$$

双力 A、双力 B 份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

4) 双力 A 份额和双力 B 份额的参考净值公告

双力 A 和双力 B 份额参考净值在计算日当天收市后计算，并在下一日内与双力中小板基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

5、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

(2) 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

6、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。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

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、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计

算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、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人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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

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,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

(4) 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

1)基金份额净值计算出现错误时,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。

2)错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;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。

3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,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。

4)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。

5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

7、暂停估值的情形

(1)基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2)因不可抗力或其它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投资人的利益，已决定延迟估值；如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；

(4) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

8、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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

9、特殊情况的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

(七) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应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同意。

- 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；
- 4) 变更基金份额持有人大会程序；
- 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。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

7) 本基金与其他基金的合并；

8) 分级运作期内终止双力 A 份额与双力 B 份额的运作；

9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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，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) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更双力中小板份额、国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的申购费率、赎回费率或收费方式；

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 对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重大变化；

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。

（2）关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

2、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）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

（3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

（4）中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

(2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

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

(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。本基金分级运作期内基金合同终止发生清算的，根据基金合同终止日双力中小板份额、双力 A 份额与双

力 B 份额各自净值分别计算双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额三类基金份额各自的应计分配比例，在此基础上，在双力中小板份额、双力 A 份额与双力 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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 个工作日内由基金财产清算组公告；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

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本基金合同受中国法律管辖。

(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

1、本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由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、深圳证券交易所所在国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费率或佣金比例用收取认购费。

（二）基金发售后至上市交易公告书公告前的重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前未发生重要财务事项。

（三）基金资产负债表

国联安双力中小板综指分级证券投资基金截止 2012 年 4 月 9 日资产负债表（未经审计），具体如下：

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
2012 年 4 月 9 日资产负债表

资产	2012 年 4 月 9 日
资产	
银行存款	52,127,526.83
结算备付金	6,818,181.82
存出保证金	—
交易性金融资产	—
其中：股票投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	750,000,000.00
应收证券清算款	—
应收利息	984,881.90
应收股利	—

应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	809,930,590.55
负债和所有者权益	2012年4月9日
负债	
应付证券清算款	-
应付管理人报酬	199,051.79
应付托管费	43,791.38
应付交易费用	-
应付税费	-
应付赎回款	-
其他负债	30,969.26
负债合计	273,812.43
所有者权益	
实收基金	809,109,186.27
未分配利润	547,591.85
所有者权益合计	809,656,778.12
负债及所有者权益总计	809,930,590.55

注：1、报告截止日 2012 年 4 月 9 日，国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金份额净值 1.001 元，双力 A 的基金份额参考净值 1.003 元，双力 B 的基金份额参考净值 0.999 元。

2、除特别注明外，金额单位为人民币元（下同）。

八、基金投资组合

截止到 2012 年 4 月 9 日，国联安双力中小板综指分级证券投资基金的投资组合如下（本报告中财务资料未经审计）：

（一）基金资产组合情况

资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
股票		
债券	-	-
权证	-	-
买入返售证券	750,000,000.00	92.60
银行存款及清算备付金	58,945,708.65	7.28
其他资产	984,881.90	0.12
合计	809,930,590.55	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有股票投资。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有股票投资。

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有股票投资。

（四）按券种分类的债券投资组合

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有债券投资。

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有债券投资。

（六）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券发行主体本期没有被监管部门立案调查的，或在本公告书编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	984,881.90
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	984,881.90

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有转股期的可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有股票投资，不存在流通受限情况。

（2）积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于 2012 年 4 月 9 日未持有股票投资，不存在流通受限情况。

6、本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券，未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证，投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

九、重大事件揭示

根据《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号<年度报告的内容与格式>》及相关法律法规的规定，除下述事件外，本基金发售后至上市交易公告书公告前未发生的对基金份额持有人有较大影响的重大事件：

1、2012年3月3日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十一次会议审议通过，聘任邵杰军先生为公司总经理。上该事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准（证监许可[2012]264号）。

2、2012年3月24日，基金管理人发布国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同生效公告。国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于2012年3月23日正式生效。

3、2012年3月24日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周浩先生为公司督察长。上该事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准（证监许可[2012]369号）。

4、2012年4月7日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十八次会议审议通过，周泉恭先生离任公司副总经理。上该事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

(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、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、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件：

- （一）中国证监会核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的文件
- （二）《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》
- （三）《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》
- （四）《国联安双力中小板综指分级证券投资基金托管协议》
- （五）关于申请募集国联安双力中小板综指分级证券投资基金之法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

国联安基金管理有限公司

二〇一二年四月十一日