

# 华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开 华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额 持有人大会的第一次提示性公告

华安基金管理有限公司决定以通讯开会方式召开华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并于 2018 年 11 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）发布了《华安基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

## 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“华安深证 300LOF”或“本基金”）的基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 12 月 11 日起，至 2019 年 1 月 7 日 17:00 止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：华安基金管理有限公司华安深证 300LOF 基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

邮政编码：200120

联系人：谈媛

联系电话：021-38969931

## 二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》（简称“《议案》”，详见附件一）。

上述议案的内容说明详见《<关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案>的说明》（详见附件四）。

## 三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2018 年 12 月 10 日，即 2018 年 12 月 10 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

## 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件。

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或相关的业务专用章（以下简称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件

（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件

的复印件。

(3) 个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(4) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(5) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2018年12月11日起，至2019年1月7日17:00以前（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并在信封表面注明：“华安深证300LOF基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人的办公地址及联系办法如下：

收件人：华安基金管理有限公司华安深证300LOF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

邮政编码：200120

联系人：谈媛

联系电话：021-38969931

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 40088-50099（免长途话费）咨询。

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在本基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在所通知的表决截止日期第二个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

### 2、本基金基金份额持有人的表决权

本基金基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1) 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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（含 50%）；

2、本次议案须经参加会议的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自持有人大会表决通过之日起生效。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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（含 50%）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 八、本次大会相关机构

- 1、召集人（基金管理人）：华安基金管理有限公司
- 2、基金托管人：中国银行股份有限公司
- 3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：傅匀

联系方式：021-62154848

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

#### 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 40088-50099（免长途话费）咨询。

3、本基金的首次停牌时间为《华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2018 年 11 月 26 日）开市起至当日 10:30 止，10:30 后恢复交易。本基金第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2019 年 1 月 9 日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、本公告的有关内容由华安基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》的说明

华安基金管理有限公司

2018年11月27日

附件一：《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）进行转型，基金名称变更为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别变更为“混合型证券投资基金”，并修改投资目的、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、费率水平、收益分配原则、估值方法等相关事项。具体说明可详见附件四《<关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案>的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

华安基金管理有限公司

2018 年 11 月 26 日

附件二：《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
证券账户卡号/开放式基金账户号：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案			
基金份额持有人/（受托人）代理人签名或盖章			
年 月 日			
<p>说明：</p> <p>1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填基金/证券账户号的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。</p> <p>2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的（且其他各项符合会议通知规定）的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。</p>			

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）



授权委托书填写注意事项:

1、授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效；

2、委托人为机构的应当于名称后加盖公章，个人则为本人签字；

3、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权；

4、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

## 附件四：《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》的说明

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）于 2011 年 9 月 2 日成立，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》。本次华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更事宜属于实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

本次华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更方案需经参加会议的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人，本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

具体方案如下：

### 一、方案要点

### （一）更名

基金名称由“华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）”更名为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”。

### （二）变更后基金的基本情况

- 1、基金的名称：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）。
- 2、基金的类别：混合型证券投资基金。
- 3、基金的运作方式：上市契约型开放式。
- 4、基金的投资目标：通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。
- 5、上市交易地点：深圳证券交易所。
- 6、基金存续期限：不定期。

### （三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等投资相关

#### 1、投资目标

通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。

#### 2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适

当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 60%；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

### 3、投资策略

本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。

#### （1）资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。

#### （2）股票投资策略

本基金主要通过定量投资模型，发掘侧重股票价值的基本面逻辑，借助量化方法确定稳定有效的因子，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，对组合的风险暴露做合理控制，根据风险约束条件优化持仓，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金运用的量化投资模型主要包括：

##### i.多因子 alpha 模型——股票超额回报预测

多因子 alpha 模型以对中国股票市场的长期研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值、成长、盈利、技术、流动性、事件、分析师预期等等。这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方

面信息。多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理将结合市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

#### ii. 风险估测模型——有效控制风险预算

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制目标在目标范围内。

本基金将以多因子 alpha 模型估测个股的超额回报，选取并持有预期正超额回报的股票构成投资组合，以投资组合风险预算为约束条件，通过风险估测模型优化投资组合持仓。

### (3) 债券投资策略

#### 1) 资产配置策略

本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

#### 2) 利率类品种投资策略

本基金对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析和预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，并通过运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略。在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

#### 3) 信用债投资策略

本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

#### 4) 可转债投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公

司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券的债性和股性，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。

#### （4）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

#### （5）权证投资策略

本基金在实现权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。

#### （6）资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### （7）参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

### 4、投资组合限制

（1）本基金股票投资占基金资产的比例不低于 60%；

（2）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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（3）基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：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%；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 95%，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；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%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（4）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（6）基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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%；

（13）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%；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(17) 基金参与融资交易的，应当遵守下列要求：每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(18) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(19) 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。

(20) 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；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（14）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合

基金合同的约定。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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

## 5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 80\% + \text{中债综合指数收益率} \times 20\%$ 。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，该指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

本基金是股票投资比例不低于 60% 的混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或上述业绩比较基准指数停止编制或更改名称，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指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。因上述原因导致业绩比较基准的变更，需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

## 6、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

#### （四）变更后的基金资产估值方法

##### 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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

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

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

（4）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发

行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

#### 4、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 5、投资证券衍生品的估值方法

（1）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，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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。

（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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（4）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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8、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。

9、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。

当发生大额申购或赎回时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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，按照基金管理人根据基金资产净值的计算结果按规定对外予以公布。

#### （五）变更后基金的费率水平

1、年化管理费率：1.50%。

2、年化托管费率：0.25%。

3、申购费率

##### （1）场外申购费率

本基金的场外申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

除上述养老金客户外，其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
$M < 100$ 万	1.5%
$100$ 万 $\leq M < 300$ 万	1.2%
$300$ 万 $\leq M < 500$ 万	0.8%
$M \geq 500$ 万	每笔1000元

#### (2) 场内申购费率

本基金场内申购费率参照场外申购费率设定。

### 4、赎回费率

#### (1) 场外赎回费率

本基金的场外赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。具体费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
$Y < 7$ 天	1.50%
$7$ 天 $\leq Y < 30$ 天	0.75%
$30$ 天 $\leq Y < 6$ 个月	0.50%
$Y \geq 6$ 个月	0

注：6个月指180天

#### (2) 场内赎回费率

本基金场内赎回费率参照场外赎回费率设定。

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取

的赎回费中不低于总额的 50%计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的 25%计入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

基金份额持有人在基金转型前持有的原华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）份额，持有期限不受影响持续计算。

#### （六）变更后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、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；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （七）授权基金管理人修订基金合同

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

#### （八）关于基金转型安排

本基金转型为华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）后，将进入封闭期，封闭期不超过三个月，在封闭期期间，基金份额持有人所持有的基金份额在其资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.0000 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。具体份额折算方案请见基金管理

人届时发布的公告。

(九) 《华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的生效自本次持有人大会决议生效公告之日的次日起, 《华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 原《华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》同日起失效。

综上所述, 基金管理人拟提请基金份额持有人大会, 授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及《关于华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 转型并修改基金合同等相关事项的议案》的方案要点修订基金合同并实施转型方案。

## 二、基金管理人就方案相关事项的说明

### 1、华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于 2011 年 9 月 2 日成立, 基金托管人为中国银行股份有限公司, 基金募集规模达 608,040,554.70 份基金份额, 已顺利运作至今。

### 2、基金管理人将严格保证基金合同修订的合法合规

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人签字盖章, 并已经中国证监会变更注册。

### 3、关于本次基金份额持有人大会费用的说明

根据《华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定, 本次基金份额持有人大会费用以及律师费等相关费用可从基金资产列支。

## 三、转型方案的可行性

### 1、法律可行性

在《基金法》第八十三条到第八十六条对基金持有大会的召集人、召开形式以及其相关事宜都作了规定与说明, 这为基金持有大会的召开流程

提供了法律依据。

本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过，决议即可生效。

因此，基金转型方案不存在法律方面的障碍。

## 2、技术可行性

为了保障华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）持有人大会的顺利召开，基金管理人成立了工作小组，筹备、执行份额持有人大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本次转型方案进行了充分沟通和细致准备，技术可行。

因此，转型方案不存在运营技术层面的障碍。

## 四、转型方案的主要风险及预备措施

本次基金转型的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在设计转型并确定具体方案之前，基金管理人已同基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果降低转型方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向持有人大会提交转型并修改基金合同等相关事项的议案。

**附件：《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（“《基金合同》”）与《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（“《基金合同》（修订）”）修改前后对照表**

《基金合同》（修订）章节	《基金合同》	《基金合同(修订)》
全文修改基金名称	华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
第一部分 前言	<p>（一）订立《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本基金合同的目的</p> <p>订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《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《证券投资基金销售管理办法》</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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。</p> <p>3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。</p>

	<p>(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p> <p>3、订立本基金合同的原则</p> <p>订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>(二) 本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集, 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做出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。</p> <p>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, 但由于证券投资具有一定的风险, 因此不保证投资于本基金一定盈利, 也不保证基金份额持有人的最低收益。</p> <p>(三) 本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的</p> <p>法律文件, 其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述, 如与本基金合同有冲突, 均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人</p>	<p>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。</p> <p>基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人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。</p> <p>三、华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 由华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 转型而来, 华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 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, 变更后的华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 已经中国证监会变更注册。</p> <p>中国证监会对华安深证 300 指数</p>
--	---	--

	<p>和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额，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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。</p> <p>（四）本基金合同应当适用《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本基金合同的内容与届时有效的法律法规的规定有冲突，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和调整，同时就该等变更或调整进行公告。</p>	<p>证券投资基金（LOF）转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景做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。</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。</p> <p>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。</p> <p>五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。</p> <p>六、本基金主要采用量化模型构建股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投</p>
--	---	--

		<p>资过程中的多个环节，将依赖于量化模型，存在量化模型失效，导致基金业绩表现不佳的风险。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>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：</p> <p>基金或本基金：指华安深证300指数证券投资基金（LOF）；</p> <p>基金合同或本基金合同、本合同：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；</p> <p>招募说明书：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新；</p> <p>发售公告：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》</p> <p>托管协议：指《华安深证300指数证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充；</p> <p>业务规则：指华安基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则；</p> <p>中国证监会：指中国证券监</p>	<p>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：</p> <p>1、基金或本基金：指华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF），本基金由华安深证300指数证券投资基金（LOF）转型而来</p> <p>2、基金管理人：指华安基金管理有限公司</p> <p>3、基金托管人：指中国银行股份有限公司</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期的更新</p>

	<p>督管理委员会；</p> <p>中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；</p> <p>《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的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；</p> <p>《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；</p> <p>《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；</p> <p>《信息披露办法》：</p> <p>《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；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</p>	<p>7、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等</p> <p>8、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>9、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年</p>
--	--	---

	<p>流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；</p> <p>元：指人民币元；</p> <p>基金管理人：指华安基金管理有限公司；</p> <p>基金托管人：指中国银行股份有限公司；</p> <p>基金份额持有人：指根据基金合同及相关法律文件合法取得本基金基金份额的投资者；</p> <p>注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；</p> <p>注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华安基金管理有限公司或接受华安基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构，目前为中国证券登记结算有限责任公司；</p> <p>投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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；</p> <p>个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资</p>	<p>8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>12、《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</p> <p>13、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</p> <p>14、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
--	---	--

	<p>于证券投资基金的自然人；</p> <p>机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；</p> <p>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》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；</p> <p>基金份额持有人大会：指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；</p> <p>基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；</p> <p>基金合同生效日：指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，</p>	<p>15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会</p> <p>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会</p> <p>17、基金合同当事人：指受基金合同约定，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</p> <p>18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人</p> <p>19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织</p> <p>20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者</p> <p>21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> <p>22、基金份额持有人：指依基金</p>
--	--	--

	<p>中国证监会的书面确认之日；</p> <p>存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；</p> <p>认购：指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；</p> <p>申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；</p> <p>赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；</p> <p>巨额赎回：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本基金总份额的 10% 时的情形；</p> <p>上市交易：指基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；</p> <p>场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场</p>	<p>合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人</p> <p>23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p> <p>24、销售机构：指华安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所办理基金销售业务的会员单位</p> <p>25、会员单位：指具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位</p> <p>26、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回</p> <p>27、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回</p>
--	--	---

	<p>所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回；</p> <p>场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；</p> <p>注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统；</p> <p>证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；</p> <p>场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额；</p> <p>场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额；</p> <p>转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；</p> <p>系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或在证券登记结算系统内不</p>	<p>28、场外份额：指登记在登记结算系统下的基金份额</p> <p>29、场内份额：指登记在证券登记系统下的基金份额</p> <p>30、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统</p> <p>31、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统</p> <p>32、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等</p> <p>33、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华安基金管理有限公司或接受华安基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构</p> <p>34、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户</p>
--	--	---

	<p>同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为；</p> <p>跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为；</p> <p>基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；</p> <p>指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；</p> <p>代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；</p> <p>销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；</p> <p>基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；</p> <p>指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互</p>	<p>35、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户</p> <p>36、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管、定期定额等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>37、基金合同生效日：指《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日终止</p> <p>38、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期</p> <p>39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日</p> <p>41、T 日：指销售机构在规定时间内受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日</p>
--	---	---

	<p>联网网站或其它媒体；</p> <p>基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；</p> <p>交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；</p> <p>深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户；</p> <p>工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；</p> <p>开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；</p> <p>T 日：指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；</p> <p>T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；</p> <p>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；</p>	<p>42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数</p> <p>43、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日</p> <p>44、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段</p> <p>45、《业务规则》：指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订</p> <p>46、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p> <p>47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</p> <p>48、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为</p> <p>49、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请</p>
--	---	--

	<p><b>基金资产总值：</b>指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；</p> <p><b>基金资产净值：</b>指基金资产总值减去基金负债后的价值；</p> <p><b>基金份额净值</b> 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；</p> <p><b>基金资产估值：</b>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；</p> <p><b>流动性受限资产：</b>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</p> <p><b>法律法规：</b>指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及</p>	<p>将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为</p> <p><b>50、转托管：</b>指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管及跨系统转托管</p> <p><b>51、系统内转托管：</b>指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为</p> <p><b>52、跨系统转托管：</b>指投资者将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为</p> <p><b>53、定期定额投资计划：</b>指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式</p> <p><b>54、巨额赎回：</b>指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出</p>
--	---	--

	<p>对于该等法律法规的不时修改和补充；</p> <p>不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。</p>	<p>申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%</p> <p>55、元：指人民币元</p> <p>56、基金收益：本基金合同项下的基金收益即为基金利润，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</p> <p>57、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值</p> <p>59、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</p> <p>60、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</p> <p>61、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介</p> <p>62、不可抗力：指本基金合同当</p>
--	---	---

		事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
第三部分 基金的基本情况	<p>（一）基金名称</p> <p>华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）。</p> <p>二、基金的类别</p> <p>股票型</p> <p>（三）基金的运作方式</p> <p>上市契约型开放式。</p> <p>（五）基金投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>（六）标的指数</p> <p>本基金的标的指数为深证 300 价格指数。</p> <p>如果深证 300 价格指数被停止编制及发布，或深证 300 价格指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致深证 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为</p>	<p>一、基金名称</p> <p>华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）</p> <p>二、基金的类别</p> <p>混合型证券投资基金</p> <p>三、基金的运作方式</p> <p>上市契约型开放式（LOF）</p> <p>五、基金的投资目标</p> <p>通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>删除。</p>

	<p>本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象；并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。</p> <p>（七）基金份额初始面值和认购费用</p> <p>本基金的初始面值为人民币1.00元。</p> <p>本基金认购费率最高不超过5%，具体费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。</p> <p>（八）基金最低募集份额总额和最低募集金额</p> <p>本基金的募集份额总额应不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。</p> <p>（九）基金存续期限</p> <p>不定期。</p>	<p>删除。</p> <p>删除。</p> <p>六、基金存续期限</p> <p>不定期</p>
<p>第四部分 基金的历史沿革</p>	<p>四、基金份额的发售与认购</p> <p>本基金基金份额初始面值为人民</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革</p>

	<p>币 1.00 元，按初始面值发售。</p> <p>（一）发售时间</p> <p>本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。</p> <p>（二）发售方式</p> <p>本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点发售，场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售。各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。</p> <p>本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。基金销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者可及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>（三）发售对象</p> <p>本基金的发售对象为个人投资者、</p>	<p>一、本基金的历史沿革</p> <p>华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）由华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型而来。</p> <p>华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）经中国证监会 2011 年 6 月 7 日《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可【2011】884 号文）核准募集，基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。</p> <p>华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）自 2011 年 8 月 1 日至 2011 年 8 月 26 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 9 月 2 日起正式生效。</p> <p>华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）自 2018 年 X 月 X 日至 2018 年 X 月 X 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型及修</p>
--	--	---

	<p>机构投资者、合格境外机构投资者和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。</p> <p>（四）基金认购费用</p> <p>本基金认购费不高于认购金额的5%，实际执行费率在招募说明书中载明。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。</p> <p>（五）认购份数的计算方法</p> <p>本基金场外认购采用金额认购的方式，场内认购采用份额认购的方式。认购份数的具体计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>（六）募集期间认购资金利息的处理方式</p> <p>本基金的认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后折算为基金份额，归基金份额持有人所有。利息的具体金额，以注册登记机构的记录为准。</p> <p>（七）基金认购的具体规定</p> <p>投资者认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金</p>	<p>改基金合同等相关事项的议案，内容包括华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、收益分配原则、费率水平、估值方法以及修订基金合同等，并同意将转型后的基金更名为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。</p> <p>自 2018 年 X 月 X 日起，原《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）》失效，《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。</p> <p>经中国证监会 2018 年 X 月 X 日《关于准予华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）就基金转型事宜进行变更注册。</p> <p>二、基金份额的变更登记</p> <p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p>
--	---	--

	<p>合同的规定确定，并在招募说明书和基金份额发售公告中披露。</p> <p>（八）基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。</p> <p>五、基金的备案</p> <p>（一）基金备案的条件</p> <p>本基金募集期限届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；</li> <li>2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。</li> </ol> <p>（二）基金的备案</p> <p>基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集结束之日起 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。</p> <p>（三）基金合同的生效</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、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；</li> </ol>	<p>基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>
--	---	---

	<p>2、基金管理人应当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。</p> <p>3、在基金合同生效前，基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。</p> <p>（四）基金募集失败的处理方式 基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。</p> <p>（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 本合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。 法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。</p>	
第五部分 基金份额的上市交易	六、基金份额的上市交易	第五部分 基金份额的上市交易

	<p>本基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。</p> <p>(二) 上市交易的时间</p> <p>本基金合同生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。</p> <p>在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。</p> <p>(三) 上市交易的条件</p> <p>本基金合同生效后具备下列条件，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：基金申请在深交所上市应当具备下列条件：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金募集符合《基金法》的规定；</li> <li>2、募集金额不少于 2 亿元人民币；</li> <li>3、基金份额持有人不少于 1000 人；</li> <li>4、深圳证券交易所规定的其他</li> </ol>	<p>一、基金上市</p> <p>本基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金份额上市交易。</p> <p>删除。</p> <p>删除。</p>
--	--	---

	<p>条件。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（四）上市交易的规则</p> <p>1、本基金上市首日的开盘参考价为上市前一工作日的基金份额净值；</p> <p>2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；</p> <p>3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；</p> <p>4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；</p> <p>5、本基金上市交易遵循《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》及其更新及其他有关规定。</p> <p>（六）上市交易的行情揭示</p> <p>本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一工作日的基金份额净值。</p>	<p>三、上市交易的规则</p> <p>本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《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》等有关规定。</p> <p>五、上市交易的行情揭示</p> <p>本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值。</p>
--	--	---

	<p>(七) 上市交易的停复牌与暂停、恢复上市</p> <p>本基金的停复牌与暂停、恢复上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。</p> <p>发生下列情形之一时,本基金应暂停上市:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人;</li> <li>2、基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份;</li> <li>3、违反国家法律、行政法规,中国证监会决定暂停本基金上市;</li> <li>4、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情形。</li> </ol> <p>发生上述暂停上市情形时,基金管理人在接到深圳证券交易所通知后,应立即在至少一种指定媒体上刊登暂停上市公告。</p> <p>暂停上市情形消除后,基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请;经深圳证券交易所核准后,可恢复本基金上市,并在至少一种指定媒体上刊登恢复上市公告。</p> <p>(八) 终止上市交易</p> <p>发生下列情况之一时,本基金应</p>	<p>六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照法律法规及深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>删除。</p>
--	---	--

	<p>终止上市交易：</p> <p>1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；</p> <p>2、基金合同终止；</p> <p>3、基金份额持有人大会决定终止上市；</p> <p>4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。</p> <p>发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定媒体上刊登终止上市公告。</p>	
<p>第六部分 基金份额的申购、赎回与转换</p>	<p>（一）申购与赎回的场所</p> <p>本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。具体的销售网点和会员单位的名单将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。</p> <p>（二）申购与赎回办理的开放日</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外销售机构的销售网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。销售机构的具体信息将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p>

	<p>及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资者应在开放日申请办理基金份额的申购和赎回。本基金场外申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；场内申购和赎回的开放日为深圳证券交易所的正常交易日。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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中规定或另行公告。</p> <p>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。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回或转换的价格为下一开放日基金份额申购、</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场、证券、期货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介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金管理人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。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回</p>
--	---	---

	<p>赎回或转换的价格。</p> <p>2、申购与赎回的开始时间</p> <p>本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理场外申购。</p> <p>本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理场外赎回。</p> <p>本基金场内申购、赎回开始办理的时间由基金管理人根据注册登记机构的相关规定确定。</p> <p>在确定申购开始时间与赎回开始时间后，基金管理人应在开始办理申购、赎回的具体日期前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>（三）申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、基金份额持有人在场外赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认</p>	<p>开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按</p>
--	---	---

	<p>购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；</p> <p>4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；</p> <p>5、投资者办理场外申购、赎回应使用基金账户，办理场内申购、赎回应使用深圳证券账户；</p> <p>6、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行；</p> <p>基金管理人在不损害基金份额持有人实质利益的情况下可更改上述原则，但基金管理人应在新原则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>（四）申购与赎回的程序</p> <p>1、申购与赎回申请的提出</p> <p>基金投资者须按销售机构规定的</p>	<p>新规定执行；</p> <p>4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>5、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>6、投资人通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券账户（人民币普通股票账户和证券投资基金账户）。</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。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。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确</p>
--	--	---

	<p>手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。</p> <p>投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。</p> <p><b>2、申购与赎回申请的确认</b></p> <p>T日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在T+1日对投资者申购、赎回申请的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式及时查询申请的确认情况。基金销售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。</p> <p><b>3、申购与赎回申请的款项支付</b></p> <p>申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。</p> <p>投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构及其相</p>	<p>认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p><b>3、申购和赎回申请的确认</b></p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。</p> <p>基金管理人可以在法律法规和基</p>
--	--	--

	<p>关基金销售机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。</p> <p>（五）申购与赎回的数额限制</p> <p>1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。</p> <p>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金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，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。</p> <p>3、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对申购金额和赎回份额的数额限制，基金管理人进行前述调整必须按</p>	<p>金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券</p>
--	---	---

	<p>照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>(六) 申购份额与赎回金额的计算方式</p> <p>1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，其中，通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资者。本基金申购份额的具体计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均保留小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。本基金赎回金额的具体计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>(七) 申购和赎回的费用及其用</p>	<p>交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。</p> <p>5、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，基金管理人可以采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。</p> <p>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，根据基金合同约定或经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公</p>
--	--	---

	<p>途</p> <p>1、本基金申购费最高不超过申购金额的 5%，赎回费最高不超过赎回金额的 5%。</p> <p>2、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额减净申购金额。实际执行的申购费率在招募说明书中载明。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。</p> <p>3、本基金的场外赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率；场内赎回适用费率需根据深圳证券交易所的相关业务规则和本基金合同另行制定。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费。</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对于持续持有期</p>	<p>告。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。场内申购份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式，保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者。场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由</p>
--	---	--

	<p>少于 7 日的投资者收取的赎回费全额归入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p> <p>5、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>（八）申购与赎回的注册登记</p> <p>1、本基金申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）起有权赎回该部分基金份额。</p> <p>2、经基金销售机构同意，投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。</p> <p>3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。</p>	<p>基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由申购基金份额的投资者承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例应根据相关规定执行，并在招募说明书中列示。</p> <p>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基</p>
--	---	---

	<p>4、中国证券登记结算有限责任公司可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,基金管理人于新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>单个开放日中,本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%,即认为发生了巨额赎回。</p> <p>对于场内赎回部分,当日未获受理的场内赎回将自动撤销。中国证券登记结算有限责任公司的业务规则变更时,依其最新业务规则处理。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 接受全额赎回:当基金管理人认为有能力兑付投资者的全</p>	<p>金申购费率和赎回费率。</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p> <p>3、证券、期货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。</p> <p>4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、</p>
--	--	---

	<p>部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为兑付投资者的全部赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 40%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 40% 的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 40% 以内（含 40%）</p>	<p>基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50% 比例要求的情形时。</p> <p>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>9、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申购申请。</p> <p>10、法律法规规定、基金合同约定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述除第 4、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本</p>
--	---	---

	<p>的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在3个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时应当在指定媒体予以公告。</p> <p>(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在指定媒体上公告。</p> <p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；</p>	<p>金将退还给投资人。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。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；</p> <p>3、证券、期货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；</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时；</p> <p>6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</p> <p>7、法律法规规定、基金合同约定或中国证监会认定的其他情形。</p>
--	---	--

	<p>(4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>(5) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；</p> <p>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形；</p> <p>(7) 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；</p> <p>(8) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定全部或部分拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。除上述第（5）、（6）项情形外，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。在暂停申购的情形消除时，</p>	<p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。</p> <p>若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回申请，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。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公告。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p>
--	--	---

	<p>基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p> <p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p>（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>（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；</p> <p>（3）基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>（4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；</p> <p>（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确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</p> <p>（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。除非发生巨额赎回，</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先</p>
--	---	---

	<p>已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。</p> <p>3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。</p> <p>4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。</p> <p>（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个估值日的基金份额净值。</p> <p>（2）如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个估值日的基金份额净值。</p> <p>（3）如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应</p>	<p>权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，</p>
--	---	---

	<p>每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在至少一种指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个估值日的基金份额净值。</p> <p>（十一）基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。</p>	<p>并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>4、场内巨额赎回的处理方式按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司有关业务规则执行。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、上述暂停情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近1个估值日的基金份额净值。</p> <p>3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。</p> <p>十一、基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转</p>
--	---	---

	<p>八、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押</p> <p>(一) 非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。</p> <p>基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承；</p> <p>“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。</p> <p>基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构</p>	<p>换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p> <p>十二、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人，或按法律法规或有权机关规定的方式处理。</p> <p>继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。</p>
--	---	--

	<p>不得办理该项业务。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和基金合同规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。</p> <p>对于符合条件的非交易过户申请按中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所等相关机构的有关规定办理。</p> <p>（二）转托管</p> <p>本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。</p> <p>本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。</p> <p>1、系统内转托管</p> <p>（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注</p>	<p>十三、基金的转托管</p> <p>本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购或通过跨系统转托管从场内转入的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转入的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。登记在证券登记系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在登记结算系统中的基金份额可申请场外赎回。</p> <p>本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。</p> <p>1、系统内转托管</p> <p>（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。</p> <p>（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</p>
--	--	---

	<p>册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。本基金在募集期内不得办理系统内转托管。</p> <p>（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>具体办理方法参照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司以及基金代销机构的有关规定。</p> <p><b>2、跨系统转托管</b></p> <p>（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。</p> <p>（2）本基金处于募集期内、权益分派期间或处于质押、冻结状态时，不得办理跨系统转托管。</p> <p>（3）本基金跨系统转托管的具</p>	<p>（3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>具体办理方法参照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司以及基金销售机构的有关规定。</p> <p><b>2、跨系统转托管</b></p> <p>（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。</p> <p>（2）本基金处于权益分派期间或处于质押、冻结状态时，不得办理跨系统转托管。</p> <p>（3）本基金跨系统转托管的具体业务按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。</p> <p><b>十五、基金份额的冻结、解冻和质押</b></p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一</p>
--	--	---

	<p>体业务按照深证证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。</p> <p>（三）冻结与解冻</p> <p>基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，除非法律法规或有权机关另有要求，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。</p> <p>（四）基金份额的质押</p> <p>如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定和实施相应的业务规则。</p>	<p>并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。</p> <p>如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。</p> <p>新增：</p> <p>十四、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p> <p>十六、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根</p>
--	--	---

		<p>据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</p> <p>十七、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及其权利和义务</p>	<p>九、基金合同当事人及其权利和义务</p> <p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>名称：华安基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层</p> <p>法定代表人：朱学华</p> <p>成立日期：1998 年 6 月 4 日</p> <p>批准设立机关：中国证券监督管理委员会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基金字【1998】20 号</p> <p>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</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.5 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称：华安基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层</p> <p>法定代表人：朱学华</p> <p>设立日期：1998 年 6 月 4 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.5 亿元</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：（021）38969999</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(1) 依法募集资金；</p>

	<p>2、基金管理人的权利</p> <p>(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；</p> <p>(2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；</p> <p>(3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；</p> <p>(4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；</p> <p>(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；</p> <p>(6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其</p>	<p>(2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；</p> <p>(3) 依照基金合同收取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；</p> <p>(4) 销售基金份额；</p> <p>(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；</p> <p>(6) 依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</p> <p>(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；</p> <p>(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；</p> <p>(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；</p> <p>(10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；</p> <p>(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎</p>
--	--	--

	<p>他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；</p> <p>(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；</p> <p>(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；</p> <p>(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；</p> <p>(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；</p> <p>(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；</p> <p>(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；</p> <p>(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；</p> <p>(14) 依据法律法规和基金合同</p>	<p>回和转换申请；</p> <p>(12) 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；</p> <p>(13) 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；</p> <p>(14) 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；</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换等的业务规则；</p> <p>(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(1) 依法募集资金，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申购、赎回和登记事宜；</p>
--	--	---

	<p>的规定，召集基金份额持有人大会；</p> <p>(15) 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并确定有关费率；</p> <p>(16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。</p> <p><b>3、基金管理人的义务</b></p> <p>(1) 依法申请并募集基金，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；</p> <p>(2) 办理基金备案手续；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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分别管理、分别记账，进行证券投资；</p> <p>(6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；</p>	<p>(2) 办理基金备案手续；</p> <p>(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；</p> <p>(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；</p> <p>(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分别管理，分别记账，进行证券投资；</p> <p>(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；</p> <p>(7) 依法接受基金托管人的监督；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、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资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</p>
--	---	--

	<p>(7) 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；</p> <p>(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；</p> <p>(9) 依法接受基金托管人的监督；</p> <p>(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；</p> <p>(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；</p> <p>(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；</p> <p>(14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得向他人泄露；</p> <p>(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</p> <p>(16) 依据《基金法》等相关法律法规的规定保存基金财产管理</p>	<p>(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>(11) 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；</p> <p>(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；</p> <p>(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；</p> <p>(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</p> <p>(15) 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；</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资</p>
--	--	---

	<p>业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；</p> <p>(17) 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；</p> <p>(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实施其他法律行为；</p> <p>(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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>(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；</p> <p>(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。</p>	<p>料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；</p> <p>(19) 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；</p> <p>(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；</p> <p>(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；</p> <p>(23) 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实施其他法律行为；</p> <p>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(25) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他</p>
--	---	--

		义务。
第七部分 基金合同当事人及其权利 义务	九、基金合同当事人及其权利 义务  (二) 基金托管人  1、基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 成立日期：1983年10月31日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有	二、基金托管人  (一) 基金托管人简况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983年10月31日 批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号） 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整 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】24号  (二) 基金托管人的权利与义务  1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：  (1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；  (2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或

	<p>价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>2、基金托管人的权利</p> <p>（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；</p> <p>（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；</p> <p>（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；</p> <p>（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；</p> <p>（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；</p> <p>（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。</p> <p>3、基金托管人的义务</p> <p>（1）安全保管基金财产；</p> <p>（2）设立专门的基金托管部，</p>	<p>监管部门批准的其他费用；</p> <p>（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；</p> <p>（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；</p> <p>（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；</p> <p>（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；</p> <p>（2）设立专门的基金托管部门，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；</p>
--	---	---

	<p>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；</p> <p>(3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；</p> <p>(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；</p> <p>(5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；</p> <p>(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；</p> <p>(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>(9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；</p> <p>(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(11) 对基金财务会计报告、季</p>	<p>(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；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；</p> <p>(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；</p> <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，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；</p> <p>(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予以保密，不得向他人泄露；</p> <p>(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>(9) 办理与基金托管业务活动</p>
--	--	--

	<p>度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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；</p> <p>(12) 保存基金份额持有人名册；</p> <p>(13) 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；</p> <p>(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；</p> <p>(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；</p> <p>(17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；</p> <p>(18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；</p> <p>(19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；</p> <p>(20) 法律法规、基金合同及中</p>	<p>有关的信息披露事项；</p> <p>(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；</p> <p>(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>(12) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；</p> <p>(15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；</p> <p>(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；</p> <p>(17) 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；</p> <p>(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告</p>
--	--	--

	<p>国证监会规定的其他义务。</p>	<p>中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；</p> <p>（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p> <p>（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及其权利义务</p>	<p>九、基金合同当事人及其权利义务</p> <p>（三）基金份额持有人</p> <p>1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《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。</p> <p>每份基金份额具有同等的合法权</p>

	<p>2、基金份额持有人的权利</p> <p>(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；</p> <p>(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。</p> <p>3、基金份额持有人的义务</p> <p>(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；</p> <p>(2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；</p> <p>(5) 执行基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；</p> <p>(8) 提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的</p>	<p>益。</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>(3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；</p> <p>(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；</p> <p>(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；</p> <p>(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；</p> <p>(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；</p> <p>(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费</p>
--	--	---

	<p>更新和补充，并保证其真实性；</p> <p>(9) 法律法规及基金合同规定的其他义务。</p>	<p>用；</p> <p>(5) 在其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；</p> <p>(6) 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；</p> <p>(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>十、基金份额持有人大会</p> <p>(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。</p> <p>(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、终止基金合同；</li> <li>2、转换基金运作方式；</li> <li>3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；</li> <li>4、更换基金管理人、基金托管人；</li> <li>5、变更基金类别；</li> </ol>	<p>第八部分 基金份额持有人大会</p> <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 终止《基金合同》；</li> <li>(2) 更换基金管理人；</li> <li>(3) 更换基金托管人；</li> </ol>

	<p>6、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；</p> <p>7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；</p> <p>8、本基金与其他基金合并；</p> <p>9、单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%，下同）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>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；</p> <p>11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>1、调低基金管理费率、基金托管费率和其他应由基金承担的费用；</p> <p>2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；</p> <p>3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；</p>	<p>（4）转换基金运作方式；</p> <p>（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>（6）变更基金类别；</p> <p>（7）本基金与其他基金的合并；</p> <p>（8）变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>（9）变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>（13）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除外；</p> <p>（14）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、在符合法律法规和基金合同相关规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，</p>
--	---	--

	<p>4、基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；</p> <p>5、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；</p> <p>6、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；</p> <p>7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。</p> <p>（四）召集方式</p> <p>1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。</p> <p>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。</p>	<p>以下情况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：</p> <p>（1）调低除基金管理费与基金托管费以外其他应由基金承担的费用；</p> <p>（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；</p> <p>（3）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>（4）因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动或中国证监会的相关规定发生变动而应当对《基金合同》进行修改；</p> <p>（5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；</p> <p>（6）增加、减少或调整基金份额类别及定义；</p> <p>（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户、定期定额投资、收益分配等业务规则；</p> <p>（8）本基金推出新业务或新服务；</p>
--	--	--

	<p>3、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、代表基金份额 10%的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，并至少提前 30 日报中国证监会备案。</p>	<p>(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p> <p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。</p> <p>2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。</p> <p>3、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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p>4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出</p>
--	--	--

	<p>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。</p> <p>6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。</p> <p>(五) 通知</p> <p>召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、会议召开的时间、地点、方式；</li> <li>2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；</li> <li>3、代理投票授权委托书送达时间和地点；</li> <li>4、会务常设联系人姓名、电话；</li> <li>5、权益登记日；</li> <li>6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见的提交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。</li> </ol>	<p>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（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p>5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金</p>
--	---	---

	<p>(六) 开会方式</p> <p>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以及法律法规或监管机构允许的其他方式。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。</p> <p>现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；</p> <p>2、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，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）。</p>	<p>管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。</p> <p>6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。</p> <p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：</p> <p>(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；</p> <p>(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；</p> <p>(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；</p> <p>(4) 授权委托证明的内容要求（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；</p> <p>(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；</p> <p>(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；</p> <p>(7) 召集人需要通知的其他事项。</p>
--	--	--

	<p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；</p> <p>3、本人直接出具意见或授权他人代表出具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；</p> <p>4、直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；</p> <p>5、会议通知公布前已报中国证监会备案。</p> <p>如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。</p>	<p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>基金份额持有人大会可通过现场开会、通讯开会或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委</p>
--	---	---

	<p>(七) 议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>(1) 议事内容限为本条前述第</p> <p>(二) 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。</p> <p>(2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案，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至少 35 日提交召集人并由召集人公告。</p> <p>(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：</p> <p>a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。</p>	<p>托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；</p> <p>(2) 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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的</p>
--	---	--

	<p>b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。</p> <p>（4）代表基金份额 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，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得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。</p> <p>（5）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。</p> <p>2、议事程序</p> <p>在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在</p>	<p>基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/3（含 1/3）。</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议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基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；</p> <p>（3）本人直接出具表决意见或</p>
--	--	---

	<p>所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。</p> <p>(八) 表决</p> <p>1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。</p> <p>2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：</p> <p>(1) 特别决议</p> <p>对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>(2) 一般决议</p> <p>对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上通过。</p> <p>更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。</p> <p>基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛</p>	<p>授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的1/2（含1/2）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表1/3以上（含1/3）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；</p> <p>(4) 上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。</p> <p>3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、</p>
--	--	---

	<p>盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p> <p>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。</p> <p>(九) 计票</p> <p>1、现场开会</p> <p>(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。</p> <p>(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大</p>	<p>电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。</p> <p>五、议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项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。</p> <p>基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。</p> <p>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。</p> <p>2、议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程</p>
--	--	---

	<p>会主持人当场公布计票结果。</p> <p>(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。</p> <p>(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下,如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的,则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。</p> <p>2、通讯方式开会</p> <p>在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:</p> <p>由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。</p> <p>(十) 生效与公告</p> <p>1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法規规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核</p>	<p>序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表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所持表决权的1/2以上(含1/2)选举产生一名基金份额持有人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拒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。</p> <p>会议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)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。</p> <p>(2) 通讯开会</p> <p>在通讯开会的情况下,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2个工作</p>
--	---	--

	<p>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。</p> <p>2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。</p> <p>3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。</p> <p>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。</p> <p>（十一）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。</p>	<p>日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。</p> <p>六、表决</p> <p>基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。</p> <p>基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：</p> <p>1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 1/2 以上（含 1/2）通过方为有效；除下列第 2 项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。</p> <p>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> <p>基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>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，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为</p>
--	--	---

		<p>有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p> <p>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。</p> <p>七、计票</p> <p>1、现场开会</p> <p>（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。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。</p> <p>（2）监票人应当在基金份额持</p>
--	--	--

		<p>有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。</p> <p>(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。</p> <p>(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。</p> <p><b>2、通讯开会</b></p> <p>在通讯开会的情况下，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（若由基金托管人召集，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拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p> <p><b>八、生效与公告</b></p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监</p>
--	--	---

		<p>会备案。</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>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议。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。</p> <p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第九部分 基金管理 人、基金托管人 的更换条件和程序</p>	<p>十一、基金管理 人、基金托管人 的更换条件和程序</p> <p>（一）基金管理 人和基金托管人 的更换条件</p> <p>1、有下列情形 之一的，基金管 理人职责终止， 须更换基金管理 人：</p> <p>（1）基金管理 人被依法取消基</p>	<p>第九部分 基金 管理人、基金托 管人的更换条件 和程序</p> <p>一、基金管理 人和基金托管人 职责终止的情形</p> <p>（一）基金管 理人职责终止的 情形</p> <p>有下列情形之 一的，基金管理 人职责终止：</p>

	<p>基金管理资格；</p> <p>(2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；</p> <p>(3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；</p> <p>(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：</p> <p>(1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；</p> <p>(2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；</p> <p>(3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；</p> <p>(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>1、基金管理人的更换程序</p> <p>原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。</p> <p>(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p>	<p>1、被依法取消基金管理资格；</p> <p>2、被基金份额持有人大会解任；</p> <p>3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>(二) 基金托管人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一的，基金托管人职责终止：</p> <p>1、被依法取消基金托管资格；</p> <p>2、被基金份额持有人大会解任；</p> <p>3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>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</p>
--	--	---

	<p>(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。</p> <p>(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种指定媒体上公告。</p> <p>(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，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。</p> <p>(5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，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。</p> <p>(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。</p> <p>2、基金托管人的更换程序 原基金托管人退任后，基金份额</p>	<p>内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> <p>3、临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值或净值；</p> <p>7、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</p>
--	---	---

	<p>持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。</p> <p>(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上公告。</p> <p>(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，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。</p> <p>(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，基金管理人应当按照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，</p>	<p>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；</p> <p>8、基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权 2/3 以上（含 2/3）表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> <p>3、临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效</p>
--	--	---

	<p>审计费用在基金财产中列支。</p> <p>3、基金管理人与基金托管人同时更换</p> <p>(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；</p> <p>(2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；</p> <p>(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 2 日内在指定媒体上联合公告。</p> <p>4、新基金管理人接受基金管理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。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取基金管理费或基金托管费。</p>	<p>后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；</p> <p>6、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，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值或净值；</p> <p>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并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。</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>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（含 10%）的基金份额持有人提名新任基金管理人和新任基金托管人；</p> <p>2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；</p> <p>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</p>
--	---	---

		<p>人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上联合公告。</p> <p>三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
第十部分 基金的托管	<p>十二、基金的托管</p> <p>本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《<b>华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)</b> 托管协议》，以明确基金管理人与基金托管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。</p>	<p>第十部分 基金的托管</p> <p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。</p> <p>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财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露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。</p>
	<p>十三、基金的销售</p> <p>(一) 本基金的销售业务指接受</p>	删除。

	<p>投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资和客户服务等业务。</p> <p>（二）本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。</p>	
<p>第十一部分 基金份额的登记</p>	<p>十四、基金份额的注册登记</p> <p>（一）本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。</p> <p>（二）本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金的注册登记业务根据《中</p>	<p>第十一部分 基金份额的登记</p> <p>一、基金份额的登记业务</p> <p>本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。</p> <p>二、基金登记业务办理机构</p>

	<p>国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》等相关业务规则办理。</p> <p>本基金的份额采用分系统登记原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。</p> <p>基金管理人应与注册登记机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。</p> <p>（三）基金合同各当事人确认，基金的注册登记机构享有如下权利：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、建立并管理投资者基金账户；</li> <li>2、从事基金注册登记、结算等业务；</li> <li>3、受托发放基金红利；</li> <li>4、取得注册登记费；</li> <li>5、建立并保管基金份额持有人</li> </ol>	<p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、取得登记费；</li> <li>2、建立和管理投资者基金账户；</li> <li>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；</li> <li>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；</li> <li>5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</li> </ol> <p>四、基金登记机构的义务</p> <p>基金登记机构承担以下义务：</p>
--	--	---

	<p>开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；</p> <p>6、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，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媒体上公告；</p> <p>7、法律法规规定的其他权利。</p> <p>（四）注册登记机构履行如下职责：</p> <p>1、建立和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；</p> <p>2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；</p> <p>3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；</p> <p>4、接受基金管理人的监督；</p> <p>5、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录15年以上；</p> <p>6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；</p> <p>7、按本基金合同及招募说明书、</p>	<p>1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；</p> <p>2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；</p> <p>3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；</p> <p>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带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；</p> <p>5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；</p> <p>6、接受基金管理人的监督；</p> <p>7、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>
--	--	--

	<p>定期更新的招募说明书的规定，为投资者办理非交易过户、转托管等业务、提供基金收益分配等其他必要的服务；</p> <p>8、法律法规规定的其他职责。</p> <p>（五）注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。</p>	
第十二部分 基金的投资	<p>十五、基金的投资</p> <p>（一）投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>（二）投资范围和投资比例</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象，为更好实现投资目标，本基金可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、新股（首次发行或增发等）、债券、</p>	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标</p> <p>通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国</p>

	<p>现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%；其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>（三）投资理念</p> <p>指数化投资具有低成本、管理透明及分散化程度高等优点，能稳定地获得与标的指数相近的回报。本基金遵循指数化投资理念，采用全复制的被动投资策略构建投资组合，为投资者提供一个有效的指数化投资工具，力争使投资者充分分享中国经济增长和证券市场发展的成果。</p> <p>（四）标的指数</p> <p>本基金的标的指数为深证 300 价格指数。</p>	<p>证监会相关规定）。</p> <p>本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 60%；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。</p> <p>三、投资策略</p> <p>本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益</p>
--	---	--

	<p>深证 300 价格指数（简称“深证 300P”，当前代码为 399007）是由深圳证券交易所委托深圳证券信息有限公司编制并发布的市场指数，指数成份股包括在深圳证券交易所上市的市值占比最高、成交最活跃的 300 只 A 股股票，选样范围覆盖深市主板、中小板和创业板，充分反映深市多层次资本市场的特点，适合作为指数基金的跟踪标的。</p> <p>（五）投资策略</p> <p>本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合</p>	<p>和基金资产的长期增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要通过定量投资模型，发掘侧重股票价值的基本面逻辑，借助量化方法确定稳定有效的因子，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，对组合的风险暴露做合理控制，根据风险约束条件优化持仓，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>本基金运用的量化投资模型主要包括：</p> <p>1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测</p> <p>多因子 alpha 模型以对中国股票市场的长期研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来</p>
--	--	---

	<p>理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不得超过4%。当预期指数成份股或权重调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时，或者因市场因素影响或法律法规限制等特殊情况导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对基金的投资组合进行适当调整，采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债，目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产；同时，本基金也将适当参与债券配售，提高基金资产的投资收益。</p> <p>（六）投资管理</p> <p>1、投资决策依据</p> <p>（1）法律法规和本《基金合同》的有关规定；</p> <p>（2）标的指数编制、调整等相关规定；</p>	<p>讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值、成长、盈利、技术、流动性、事件、分析师预期等等。这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理将结合市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>2) 风险估测模型——有效控制风险预算</p> <p>本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。</p> <p>本基金将以多因子 alpha 模型估测个股的超额回报，选取并持有预期正超额回报的股票构成投资组合，以投资组合风险预算为约束条件，通过风险估测模型优化投资组合持仓。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济运行情</p>
--	--	---

	<p>(3) 对证券市场发展趋势的研究与判断。</p> <p>2、投资决策体系</p> <p>本基金管理人实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明确和运作规范。投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，投资协调小组是基金投资的协调机构和中间桥梁，投资协调小组由基金投资部、被动投资部、研究发展部、固定收益部的负责人及业务骨干组成。基金经理是基金运作的直接管理人。</p> <p>3、投资管理程序</p> <p>研究支持、投资决策、组合构建、交易、评估、组合维护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。</p> <p>(1) 研究支持：被动投资部依托公司整体研究平台，整合外部研究机构的研究成果开展标的指数跟踪，通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析，进行</p>	<p>况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。</p> <p>(2) 利率类品种投资策略</p> <p>本基金对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析 and 预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，并通过运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略。在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。</p> <p>(3) 信用债投资策略</p> <p>本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极发</p>
--	---	---

	<p>基金资产流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。</p> <p>(2) 投资决策：投资决策委员会依据被动投资部金融工程小组提供的研究报告，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，每日进行基金投资管理的日常决策。</p> <p>(3) 组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数成份股权重的方式来构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。</p> <p>(4) 交易执行：集中交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。</p> <p>(5) 绩效评估：风险管理部定期和不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和评估，并对风险隐患提出预警。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。</p>	<p>掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。</p> <p>(4) 可转债投资策略</p> <p>可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券的债性和股性，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值</p>
--	---	--

	<p>(6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股公司行为、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，采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>(7) 合规监察：合规监察稽核部对整个投资管理流程进行实时监控。</p> <p>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管理程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。</p> <p>(七) 业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准：  <math>95\% \times \text{深证 300 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利率}</math></p> <p>如果深证 300 价格指数被停止编制及发布，或深证 300 价格指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致深证 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理</p>	<p>水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金在实现权证投资时，将通过权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金股票投资占基金资</p>
--	--	---

	<p>人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象（包括但不限于依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数），并相应变更业绩比较基准。基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。</p> <p>（八）风险收益特征</p> <p>本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>（九）投资禁止行为与限制</p> <p>1、禁止用本基金财产从事以下行为</p> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基</p>	<p>产的比例不低于 60%；</p> <p>（2）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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>（3）基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：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%；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 95%，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；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%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合</p>
--	--	---

	<p>金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p><b>2、基金投资组合比例限制</b></p> <p>(1) 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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；</p> <p>(2) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，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%，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%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；</p> <p>(3) 本基金财产参与股票发行</p>	<p>基金合同关于股票投资比例的有约定；</p> <p>(4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(6) 基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；</p> <p>(7) 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%；</p> <p>(8) 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%；</p> <p>(9) 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%；</p> <p>(10) 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%；</p>
--	---	---

	<p>申购，所申报的金额不超过本基金总资产，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；</p> <p>（4）现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>（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本基金资产净值的 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本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；</p> <p>（6）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；</p> <p>（7）法律法规和基金合同规定的其他投资比例限制。</p> <p>3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或</p>	<p>（11）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%；</p> <p>（12）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%；</p> <p>（13）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%；</p> <p>（14）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；</p> <p>（15）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；</p> <p>（16）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购</p>
--	--	--

	<p>取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述（4）、（5）、（6）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p> <p>（十）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</li> <li>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；</li> <li>3、有利于基金财产的安全与增值；</li> <li>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</li> </ol>	<p>到期后不展期；</p> <p>（17）基金参与融资交易的，应当遵守下列要求：每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>（18）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>（19）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%；</p> <p>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。</p> <p>（20）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；</p> <p>（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（14）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、</p>
--	---	--

	<p>关系的第三人牟取任何不当利益。</p>	<p>基金规模变动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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>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。在上述期间内，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。</p> <p><b>2、禁止行为</b></p> <p>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：</p> <p>(1) 承销证券；</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p>
--	------------------------	---

		<p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>(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；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>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的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消</p>
--	--	--

		<p>或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：沪深300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。</p> <p>沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，该指数编制合理、透明，市场覆盖率较广，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。</p> <p>本基金是股票投资比例不低于60%的混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、</p>
--	--	--

		<p>指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或上述业绩比较基准指数停止编制或更改名称，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指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。因上述原因导致业绩比较基准的变更，需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法</p> <p>1、基金管理人按照国家有关规</p>
--	--	--

		<p>定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；</p> <p>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；</p> <p>3、有利于基金财产的安全与增值；</p> <p>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正当利益。</p>
	<p>十六、基金的融资、融券</p> <p>本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。</p>	删除。
<p>第十三部分 基金 的财产</p>	<p>十七、基金的财产</p> <p>（一）基金资产总值</p> <p>本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。</p> <p>（二）基金资产净值</p> <p>本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。</p> <p>（三）基金财产的账户</p> <p>本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。</p>	<p>第十三部分 基金的财产</p> <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。</p> <p>二、基金资产净值</p> <p>基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。</p> <p>三、基金财产的账户</p> <p>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、</p>

	<p>(四) 基金财产的保管及处分</p> <p>1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。</p> <p>2、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，归基金财产。</p> <p>3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。</p> <p>4、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p>	<p>基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p> <p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>十八、基金资产的估值</p> <p>(一) 估值目的</p> <p>基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金</p>	<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>一、估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披</p>

	<p>份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。</p> <p>(二) 估值日</p> <p>本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。</p> <p>(三) 估值对象</p> <p>基金所持有的金融资产和金融负债。</p> <p>(四) 估值方法</p> <p>1、股票估值方法</p> <p>(1) 上市流通股票的估值</p> <p>上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(2) 未上市股票的估值</p> <p>送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘</p>	<p>露基金净值的非交易日。</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p>本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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。</p> <p>(2) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值</p>
--	--	---

	<p>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。</p> <p>首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。</p> <p>(3) 有明确锁定期股票的估值 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。</p> <p>2、固定收益证券的估值办法</p> <p>(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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。</p> <p>(2) 证券交易所市场未实行净</p>	<p>净价估值。</p> <p>(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃</p>
--	---	---

	<p>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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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, 按有交易的最近交易日所采用的净价估值; 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。</p> <p>(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下, 按成本估值。</p> <p>(4) 在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。</p> <p>(5) 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。</p> <p>(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。</p>	<p>市场报价未能代表计量日公允价值的情况下, 按成本应对市场报价进行调整, 确认计量日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 则采用估值技术确定公允价值。</p> <p>(4) 流通受限的股票, 包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种, 回售登记截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的债券, 在发行利率与二级市场利率不存在明显差异, 未上市期间市场利</p>
--	---	--

	<p>3、权证估值</p> <p>(1) 配股权证的估值</p> <p>因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。</p> <p>(2) 认沽/认购权证的估值</p> <p>从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。</p> <p>4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。</p> <p>5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。</p> <p>6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采</p>	<p>率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、存款的估值方法</p> <p>持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>5、投资证券衍生品的估值方法</p> <p>(1) 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，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。</p>
--	---	---

	<p>用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。</p> <p>（五）估值程序</p> <p>基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p> <p>（六）暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>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；</p>	<p>（4）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。</p> <p>6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。</p> <p>8、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。</p> <p>9、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。</p> <p>当发生大额申购或赎回时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p> <p>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，</p>
--	---	--

	<p>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估值；</p> <p>4、中国证监会认定的其他情形。</p> <p>（七）基金份额净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。</p> <p>基金份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>（八）估值错误的处理</p> <p>1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。</p> <p>2、基金管理人和基金托管人将</p>	<p>共同查明原因，双方协商解决。</p> <p>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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果按规定对外予以公布。</p> <p>四、估值程序</p> <p>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0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人于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。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。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，由基金管理人按规定对外公布。</p>
--	--	---

	<p>采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。</p> <p>3、关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：</p> <p>（1）差错类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人（“差错责任方”）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。</p> <p>上述差错的主要类型包括但不限于</p>	<p>五、估值错误的处理</p> <p>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 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、估值错误类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述估值错误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。</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p>（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由</p>
--	---	---

	<p>于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。</p> <p>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。</p> <p>（2）差错处理原则</p> <p>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。</p> <p>②差错责任方对有关当事人的直</p>	<p>于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。</p> <p>（2）估值错误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，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”)，则估值错误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，</p>
--	--	---

	<p>接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对因差错遭受损失的当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑤差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，并有权要求赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，</p>	<p>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估值错误责任方。</p> <p>（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。</p> <p>3、估值错误处理程序</p> <p>估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；</p> <p>（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p> <p>（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p> <p>（1）基金份额净值计算出现错</p>
--	--	---

	<p>基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。</p> <p>⑥如果差错责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向差错责任方进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。</p> <p>⑦按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p>(3) 差错处理程序</p> <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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</p>	<p>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。</p> <p>(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并报中国证监会备案。</p> <p>(3) 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。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>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，并经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值时；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>七、基金净值的确认</p>
--	---	--

	<p>正和赔偿损失；</p> <p>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；</p> <p>⑤基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。</p> <p>4、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。</p> <p>（九）特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人、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、基金托</p>	<p>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计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定予以公布。</p> <p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 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。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，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、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、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
--	--	---

	管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。	
第十五部分 基金费用与税收	<p>十九、基金费用与税收</p> <p>(一) 基金费用的种类</p> <p>3、因基金的证券交易或结算而产生的费用；</p> <p>4、基金合同生效以后的信息披露费用；</p> <p>6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；</p> <p>7、基金资产的资金汇划费用；</p> <p>8、基金合同生效以后的指数使用费；</p> <p>9、基金上市费用；</p> <p>10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。</p> <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，按月支付。</p>	<p>第十五部分 基金费用与税收</p> <p>一、基金费用的种类</p> <p>3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；</p> <p>4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；</p> <p>6、基金的证券、期货交易费用；</p> <p>7、基金的银行汇划费用；</p> <p>8、基金的开户费用、账户维护费用；</p> <p>9、基金的上市费用及年费；</p> <p>10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p> <p>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。</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p>

	<p>经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p><b>2、基金托管人的基金托管费</b></p> <p>基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p><b>3、基金的指数使用费</b></p> <p>根据基金管理人与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的指数的使用费年费率为0.02%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方</p>	$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。</p> <p><b>2、基金托管人的托管费</b></p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法</p>
--	--	---

	<p>法如下：</p> $H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日计提的指数使用费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>自基金合同生效之日起，指数使用费每日计算，逐日累计，按季支付。指数使用费收取下限为每季度 5 万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。指数使用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次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行。</p> <p>4、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。</p> <p>（三）不列入基金费用的项目</p> <p>本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损</p>	<p>定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、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；</li> <li>2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；</li> <li>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定执行；</li> <li>4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。</li> </ol> <p>四、基金税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法</p>
--	--	---

	<p>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。</p> <p>（四）基金管理费和基金托管费的调整</p> <p>基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。</p> <p>（五）税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。</p>	<p>律、法规执行。</p>
<p>第十六部分 基金的收益与分配</p>	<p>二十、基金收益与分配</p> <p>（一）基金收益的构成</p> <p>基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。</p> <p>期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。</p> <p>（二）收益分配原则</p> <p>1、基金收益分配方式分为两种：</p>	<p>第十六部分 基金的收益与分配</p> <p>一、基金利润的构成</p> <p>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。</p> <p>二、基金可供分配利润</p> <p>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。</p> <p>三、基金收益分配原则</p> <p>1、在符合有关基金分红条件的</p>

	<p>现金分红和红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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；选择红利再投资的，现金红利则按分红实施日（具体以基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</p> <p>2、每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多12次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的20%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；</p> <p>4、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；</p> <p>5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</p> <p>2、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；</p> <p>4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指</p>
--	---	---

	<p>(三) 收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。</p> <p>(四) 收益分配方案的确定与公告</p> <p>基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。</p> <p>(五) 收益分配中发生的费用</p> <p>1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。</p> <p>2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日（具体以基金分红公告为准）的基金份额净值转为基金份额。</p>	<p>定媒介公告。</p> <p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、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。</p> <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核。基金收益分配方案确定后，由基金管理人按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p> <p>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。</p> <p>六、基金收益分配中发生的费用</p> <p>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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>
--	--	---

<p>第十七部分 基金的会计与审计</p>	<p>二十一、基金的会计与审计</p> <p>(一) 基金会计政策</p> <p>1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。</p> <p>2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。</p> <p>3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。</p> <p>5、本基金会计责任人为基金管理人。</p> <p>6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，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以书面方式确认。</p> <p>(二) 基金审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。</p> <p>2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。</p>	<p>第十七部分 基金的会计与审计</p> <p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</p> <p>3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；</p> <p>4、会计制度执行国家有关会计制度；</p> <p>6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。</p> <p>二、基金的年度审计</p> <p>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。</p> <p>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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p>
-----------------------	--	--

<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>二十二、基金的信息披露</p> <p>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至少一种指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证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。</p> <p>（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议</p> <p>基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。</p> <p>基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>（二）基金份额发售公告</p> <p>基金管理人应当就基金份额发售</p>	<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p> <p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。</p> <p>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</p> <p>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。</p> <p>三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：</p> <p>1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；</p>
----------------------	---	--

	<p>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报刊和网站上。</p> <p>（三）基金合同生效公告</p> <p>基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。</p> <p>（四）基金份额上市交易公告书</p> <p>基金份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒体上。</p> <p>（五）基金资产净值、基金份额净值公告</p> <p>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。</p> <p>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的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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述最后一个市场交易</p>	<p>2、对证券投资业绩进行预测；</p> <p>3、违规承诺收益或者承担损失；</p> <p>4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；</p> <p>5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；</p> <p>6、中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</p>
--	--	---

	<p>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报刊和网站上。</p> <p>（六）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>（七）定期报告 基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告及更新的招募说明书。</p> <p>1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>2、基金半年度报告：基金管理</p>	<p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在其网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。 基金转型经中国证监会变更注册后，基金管理人应当将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。</p> <p>（二）《基金合同》生效公告 基金管理人应当在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p>
--	--	---

	<p>人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p>	<p>(三) 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 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。</p> <p>(四) 基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前或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。</p> <p>在基金份额上市交易后或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，通过其网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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介上。</p> <p>(五) 基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》</p>
--	--	---

	<p>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>(八) 临时报告与公告</p> <p>基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。</p> <p>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事件，包括：</p> <p>2、终止基金合同；</p> <p>7、基金募集期延长；</p> <p>8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；</p> <p>10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；</p> <p>11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；</p> <p>17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；</p> <p>18、基金改聘会计师事务所；</p>	<p>、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于其网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在其网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第</p>
--	--	--

	<p>19、基金变更、增加、减少基金代销机构；</p> <p>20、基金更换基金注册登记机构；</p> <p>21、基金开始办理申购、赎回；</p> <p>22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</p> <p>23、基金发生巨额赎回并延期支付；</p> <p>24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；</p> <p>25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；</p> <p>26、基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；</p> <p>27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；</p> <p>28、中国证监会规定的其他事项。</p> <p>（九）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。</p> <p>（十）公开澄清</p> <p>在基金合同期限内，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，</p>	<p>2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>（七）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的规定编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对</p>
--	--	--

	<p>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。</p> <p>（十一）信息披露文件的存放与查阅</p> <p>招募说明书（包括更新的招募说明书）公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人、基金代销机构的住所和深圳证券交易所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。</p> <p>基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。</p> <p>上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的深圳证券交易所，供公众查阅、复制。</p> <p>投资者也可直接在基金管理人的网站查阅信息披露文件。</p>	<p>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：</p> <p>2、终止《基金合同》；</p> <p>7、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>8、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；</p> <p>9、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；</p> <p>10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p> <p>16、基金份额净值估值错误达净值百分之零点五；</p> <p>17、基金改聘会计师事务所；</p> <p>18、变更基金销售机构；</p> <p>19、更换基金登记机构；</p> <p>20、本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>21、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>23、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；</p>
--	--	--

		<p>24、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；</p> <p>25、本基金份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；</p> <p>26、本基金变更份额类别设置；</p> <p>27、基金推出新业务或服务；</p> <p>28、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；</p> <p>29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> <p>30、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。</p> <p>（八）澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，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。</p> <p>（九）基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>（十）投资资产支持证券相关公告</p> <p>基金管理人应在基金年报及半年</p>
--	--	--

		<p>报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>（十一）投资股指期货相关公告 本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>（十二）参与融资交易相关公告 本基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p> <p>（十三）中国证监会规定的其他信息。</p>
--	--	---

		<p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	---

		<p>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。</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅 招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。</p> <p>基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。</p> <p>八、暂停或延迟披露基金信息的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</li> <li>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；</li> <li>3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</li> </ol> <p>九、法律法规或中国证监会对信息披露另有规定的，从其规定。</p>
	<p>二十三、基金的业务规则 基金份额持有人应遵守基金托管人、基金管理人及其代销机构、注册登记机构和深圳证券交易所的相关交易及业务规则。</p>	<p>删除。</p>

<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>二十四、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>(一) 基金合同的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。</p> <p>2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。</p> <p>3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，以及本基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意后公布，并报中国证监会备案。</p> <p>(二) 基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，本基金合同应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；</p>	<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p> <p>2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，决议自表决通过之日起生效，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p> <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p>
---------------------------------	---	---

	<p>3、法律法规和基金合同规定的其他情形。</p> <p>基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。</p> <p>(三) 基金财产的清算</p> <p>1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。</p> <p>2、基金财产清算组</p> <p>(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现</p>	<p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p> <p>删除。</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>4、基金财产清算程序：</p> <p>(1) 《基金合同》终止情形出</p>
--	--	--

	<p>和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>3、清算程序</p> <p>(1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；</p> <p>(2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；</p> <p>(3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对基金财产进行评估和变现；</p> <p>(8) 对基金财产进行分配。</p> <p>4、清算费用</p> <p>清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。</p> <p>5、基金剩余财产的分配</p> <p>基金财产按下列顺序清偿：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 交纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿基金债务；</p> <p>(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p> <p>基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。</p> <p>对于基金缴存于中国证券登记结</p>	<p>现时，由基金财产清算小组统一接管基金；</p> <p>(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；</p> <p>(3) 对基金财产进行估值和变现；</p> <p>(7) 对基金剩余财产进行分配。</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月。</p> <p>四、清算费用</p> <p>清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。</p> <p>五、基金财产清算剩余资产的分配</p> <p>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会</p>
--	---	--

	<p>算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。</p> <p>6、基金财产清算的公告</p> <p>基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。</p> <p>7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。</p>	<p>备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>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。</p>
第二十个部分 违约责任	<p>二十五、违约责任</p> <p>（一）因基金管理人或基金托管人违约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。</p> <p>（三）基金合同当事人违反本基金合同，给基金财产或其他基金合同当事人造成损失的，应承担相应的赔偿责任。</p> <p>（三）发生下列情况时，当事人可以免责：</p> <p>1、基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；</p>	<p>第二十个部分 违约责任</p> <p>一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《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，对损失的赔偿，仅限于直接损失。</p> <p>但如发生下列情况，当事人免责：</p> <p>1、基金管理人及/或基金托管人按照当时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；</p>

	<p>2、基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行或不进行投资所造成的损失等；</p> <p>3、不可抗力。基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本合同的，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任，但法律另有规定的除外。任何一方迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。</p> <p>（四）在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。</p> <p>（五）本基金合同当事人一方违约后，其他当事方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。</p>	<p>2、基金管理人由于按照本《基金合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等；</p> <p>3、不可抗力。</p> <p>二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p> <p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
第二十一部分 争议的处理和适用的	<p>二十六、争议的处理</p> <p>（一）本基金合同适用中华人民</p>	<p>第二十一部分 争议的处理和适用的法律</p>

<p>法律</p>	<p>共和国法律并从其解释。</p> <p>（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。</p> <p>（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。</p>	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费、律师费由败诉方承担。</p> <p>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。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p>
<p>第二十二部分 基金合同的效力</p>	<p>二十七、基金合同的效力</p> <p>（一）本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。</p> <p>（二）本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>	<p>第二十二部分 基金合同的效力</p> <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或者签章，经 2018 年 X 月 X 日华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自 2018 年 X 月 X 日起，《华安量化多因子混合型证券投资基金</p>

	<p>(三) 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。</p> <p>(四) 本基金合同正本一式六份,除上报有关监管机构二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。</p> <p>(五)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式</p> <p>基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所,投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件,基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。</p>	<p>(LOF) 基金合同》生效,原《华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》同日起失效。</p> <p>2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>3、《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。</p> <p>4、《基金合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。</p> <p>5、《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。</p>
<p>第二十三部分 其他事项</p>		<p>增加:</p> <p>第二十三部分 其他事项</p> <p>《基金合同》如有未尽事宜,由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。</p>