(上接A22版) 电话:(021)23238888 传真:(021)23238800

本基金由基金管理人依賴(基金法)和其他有关法律法規。以及基金合同的規定,終中国证监会2018年7月12 监许可[2018]1106号文注册募集。除法律、行政法规或中国证监会另有规定外,任何与基金份额发售有关的当不得预值或提削效售基金份额。

> 待坝笛或提削友告基金份额。 3.体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准,请投资人就发售和购买事宜仔细阅读本基金的基金份额发

至开放式,放宗至1) 基金的存续期限

不足别。 (三) 募集方式及场所 通过各销售机构的基金销售网点或按基金管理人、销售机构提供的其他方式公开发售,各销售机构的具体名 现基金份额投售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。基金管理人可以根据情况变更、增 据售机构,并另行公告。 (四) 募集期限

7.75k 1发售之日起最长不得超过三个月,具体募集时间详见基金份额发售公告及销售机构相关公告

者和人民币合格境外机构设查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。 (六) 募集上限 (七) 基金份额的类别,基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式 1.基金份额的类别。本基金根据认申购费、销售服务费收取方式不同。将基金份额分为不同的类别。在投资者 约申期时收取场牌事费用。而不从未来则基金资产中计量销售服务费的基金份额。称为A类基金份额,在投 试、购件期时不收取认购件购费用。但从本类别基金资产中计量销售服务费的基金份额。称为A类基金份额。在投 试、购件期时不收取认购件购费用。但从本类别基金资产中计量销售服务费的基金份额。称为C类基金份额。在 来基金份额分别设置代码,分别计算和公全各类基金份额等值和各类基金份额等的部值。 基金管理人在不违反法律法期且对基金份额特有人利益无实质不利影响的的影形。可根据基金实际运行情 经与基本企业的。

至与基金托管人协商一致,增加基金份额类别或停止某类基金份额类别的销售、变更收费方式、调整基金份额 设置,或调整基金份额分类办法及规则,调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案,无需召开基

1860寸円八人公。 投资人在认购,中购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。 2、基金份额面值:本基金A类、C类基金份额发售面值为人民币1.00元。

3、认购费率 本基金A类基金份额收取认购费,C类基金份额不收取认购费。本基金A类基金份额的认购费率最高不超过

金额的增加而递减,如下表所示: A类基金份額认购金额M(元) (含认购费)

年的「「米公政人工保証目が保护財団 阿馬(公政10万元人)的本施並入交通並が額,该毛以向广土利息100元、 込购費率为10.0%、則員可得到的人場份額か。 浄认胸金額 = 100,000/(1+1.00%) = 99,009.90元 认购費用 = 100,000/1+1.00%) = 99,009.90元 认购价額 = (99,009.90+100) /1.00=99,109.90份 周、某投資人在集積計算机率的背景网点投资10万元认购本基金人类基金份額,该笔认购产生利息100元,则其 到到99,109.90份A类基金份额。

财产承担。
(3)有效认购款项在募集期间产生的银行同期活期存款利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息的具体金额及利息转的侧的具体数额以登记机构的记录为准。
(八) 投资人对基金份额的认购
1、从期时间定排
投资人可在等排期内前往本基金销售网点或以销售机构提供的基他方式办理基金份额认购手续,具体的业务办理时间详况本基金的基金份额发售公告或各销售机构框大业务办理规则。

2.投资人认购应提交的文件和办理的手续 投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构相关业务

5、0%到7月以2006 (1)投资人放映时,需按销售机构规定的方式全额疏款。 (2)投资人在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。 (3)投资人在T日规定时间内提交的认购申请,通常应在T+2日到原认购网点或以销售机构规定的其他方式 认购申请的受理情况。

查询认购申请的受理情况。 (4)销售机构对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 确认以登记机构的确认结果为难。对于认购申请及认购价额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利

人购的限额)在基金募集期内,投资人通过基金管理人的直销柜台首次认购本基金A类和C类基金份额的单笔最低限 一门,任益益等基则内,及饮入血过益适管增入的复用和已自含化、则不基金允条和C类基金价的即件单基酸性原 额为人民币10万元(含从购费),追加从购本基金人类和C类基金价的的配在金额为人民币10万元(含从购费),投 资人通过基金管理人的电子直销交易系统和其他的信机构。由于成本基金人类和C类基金份额的单笔最低限额为 人民币10元(合从购费),追加从购本基金人类和C类基金份额的建位金额为人民币10元(含从购费)。各销售机构 对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为他。 (2)本基金统集制则对单个投资人的繁壮、财金额不过规制,单一处资者持有本基金份额集中度不得达到或 者超过50%,对于可能导破单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规能50%集中度的情形。 基金管理人有权拒绝该等全征或者部分从购申请,投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为 推。但法律法规,中国证监会和《基金合同》另有规定的除外。

(九)募集资金的存放 基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专门账户,任何人不得动用。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件
本基金目基金价额及售之日起2个月内,在基金募集价额股急和不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币
且基金认购及数不少于200人的条件下,基金募集期届满成基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止
基金发售,并在10日内询请决定整金税的验验,18收到验查报告之日起10日内,向中国证监会办理基金舍案于续。
基金参照之到据金省家采作的。日基金管理人办理完准金舍案于线对保护中国证监会分组基金舍案于统。
基金参照之效据金省家采购用商募集制的基金营业分化设金时间建设金额人次件约次日对《基金合同》于全发事宜予
以合。基金与则人及将基金募集期间募集的资金产人专门账户。在基金募集有为结束前,任何人不得动用。
(一)基金合用为任金总募集期间募集的资金产人专门账户。在基金募集有为结束前,任何人不得动用。
(一)基金合品为产业的基金等条件,基金型用人应当承租下则责任。
1.以上随时的产业已经上区。2.以上的产业的企业分别是企业分别是企业分别是企业分别是企业分别是企业分别。
2.在基金募集即限届满层50日内发生处设金产品统约的表现,并加计量行同期活明存款利息。
为基金募集之公募,但是整个企业公司。2.以上是全发统全公募集全发生。2.以是在全发的企业公司。2.以上是全发生的企业公司。2.以上是全发生的企业公司。2.以上是全发的企业公司。2.以上是全发生的企业公司。2.以上是全发生的企业公司。2.以上是全发生的企业公司。2.以上是一个企

5、强重亚等等人以"康亚岛"之一的最有资格目录目。 在多鳞集变付之一切费用应由各方各目录目。 (三)基金存线期的的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后,继续90个工作日由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 基金管型人应当在定即报告中予以披露,连续60个工作日由现前送情形的,基金管理人应当向中国证监会报告 是出解为方案。如转板运作方式,与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

(一)申购和赎回场所 本基金的申募与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人 可根据情况变更或增强销售机构,并予记公告。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询与赎回。 若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式、投资人可以通过上述方式进行申购与 赎回。具体办法由基金管型人或其指定的销售机构另行公告。 (二)申购和赎回的开放日及时间 1.开放日及开放时间 投资人在开放日为则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 日的交易附间。但基金管理人根据设备注度。中国证监金份要求或基金合同的规定公告暂停申购。赎回时验外。

投资人在升成日办理基金份额的甲职料原四。具体办理时间对上海证子交易所、株州证牙实态的印以正布公司的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时龄外。基金合同性效后,若出现新价证券,朋货交易市场、证券,朋货交易产交易时间变更,其他特殊情况或根据业务需要,基金管理人可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

。基金管型人可视的6次用逐升放口及升放时即应订相应的96至,但总证至为应口的18万%。2008年77分。 这在指定域方上公告。 2.申购,城间开始日及业务办理时间 基金管型人目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。 基金管型人目基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购,赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在 起媒介上公告申购与赎回的开始时间。 基金上公告申购与赎回的开始时间。 可定之外的日期时间提出申购。赎回或转换申请且经记书的确认接受的,其基金份额申购。赎回价格为下一开

放日该类基金份额申购、赎回的价格。 E.) 申购与赎回的原则 "未知价"原则, 即申购, 嘘同价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算;

、"未知的""演則,即申與,樣回价格以申请当日收而店計算的该类基金份額净值为基准进行计算; "金額申與,勞碗赎回""演則即申與公金鄉中請,樣回以份鄉申請, 当日的申與与赎回申請可以在基金管理人规定的时间以內撤削; 張回遠鄉 "先进先出"原則,那股限稅资人以购,申购的先品次序进行顺序赎回; 遠衛 "基金份鄉持有人利益优先"。原則,基金管理人在办理基金份額申购,赎回业务时,如果发生申购,赎回 金金管理人可允和益的排形打。应当及时暂停申购,赎回业务。基金管理人必须在新规则开始实施前依照 披露办法,的有关规定在指定媒介上公告。

給投资人 情報, 特數机构对申购、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该申购,赎回申请。 申购,赎回申请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

型。 基金管理人在不违反法律法规的前提下,可对上述程序规则进行调整。基金管理人应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。 (五)申购和赎回的限制 1.本基金对单个投资人不设累计持有的基金份额上限,但法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除

外。 2.投资人通过基金管理人的直销柜台首次申购本基金单笔局低限额为人民币10万元(含申购费)。投资人通过基金管理人的电子直销交易系统和其他销售机构首次中购本基金人类和C类基金份额的单笔最低限额为人民币 10元(含申购费)。投资人通过基金管理人的直销地后台加申购本基金的最低金额为人民币10万元(含申购费)。 投资人通过基金管理人的电子直销交易系统和其他销售机构通加申购本基金人或代及基金分额的股低金额为人

2. 非购费率 本基金人类基金份额收取申购费,C类基金份额不收取申购费。A类基金份额的申购费率如下表所示: A类基金份额申购金额M(元) (全申购费

	M <50万	1.20%	
	50 万≤ M <250万	0.80%	
	250万 ≤ M < 500万	0.50%	
	M ≥500万	每笔1,000元	
本基金A类基金份额的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人如果有多笔申购,A类基金份额适用的 购费率按单笔分别计算。			
A类基金份额的申购费用由申购本基金A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场			
推广、销售、登记等各项费用。			
	于申购本基金C类基金份额的投资人,申购费率	为零。	
3.	. 由购份额的计算及金额的处理方式		

3、中则竹砌的订算及宗领的处理方式 基金的申购金额包括申购费用和净申购金额 (1)当投资人选择申购A类基金份额时,申购 1)A类基金份额的申购费率适用比例费率时 额的计算方法如下

1)A类基金份额的申购费率适用比例费 净申购金额=申购金额/(1+申购费率) 申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值)A类基金份额的申购费率活用周空全等四十

(1A英基並計600円甲剪50年9月刊60尺正確607): 阜申數合稱—申购金額—申购费用 申购费用—固定金額 申购份额—净申购金额/申购当日A类基金份额净值 (2)当投资,入选择申购C类基金份额时,不收取申购费,申购份额的计算方法如下:

(2)当投资人选择申购C类基金份额时,不收取申购资,申购份额的计算方法如下:申购份额申购免额申购当已类基金份额净值 申购份额=申购免额申购当已类基金份额净值 申购的242份额单位为份,上述计算结果均按四舍五人方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由 申购的242份。

√2。 ::某投资人投资8万元申购本基金A类基金份额,对应费率为1.20%,假设申购当日A类基金份额净值为

中罗时则 - 78, USL 68/T UBUD = 73, 195.72份 即:投资人投资8 万元申购本基金A类基金份额,假设申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0800元,则 得到73, 195.72份A类基金份额。 举例四:某投资人投资8万元申购本基金C类基金份额,无申购费,假设申购当日C类基金份额净值为1.0800元, (组织的由购的检验)。

1)本基金A类基金份额的赎回费率如下表所示 A类基金份额赎回费率

D ≥ 731 投资者可将其持有的全部或部分A类基金份額 0% 回。赎回费由赎回A类基金份额的基金份额持有人承担

持有时间D(天

。數序。 5. 胰固金额的计算及处理方式 本基金A类基金份额和C类基金份额的赎回金额的计算方式相同,按照各自对应的当日该类基金份额净 披索计算,赎回金额为赎回总金额和减赎回费用。 贼回金额的计算方式如下: 赎回总金额。现回台额。 赎回台至 赎回竞争— 赎回给第一 赎回台车 赎回金额— 随日金领减帐间等用 赎回金额=赎回总金额(赎回费用 赎回金额单位为元,计算结果均按四舍五人方法,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

赎回金额=10,880,00-10,88=10,869,12元 即:投资人赎回本基金1万份C类基金份额,持有期限为15天,假设赎回当日C类基金份额净值是1.0880元,则其

图:投资人赎回本基金1万份C类基金份额,持有期限为15大,假设赎回当口,只要证则1997年1846。 可得到的赎回金额为10,869,12元。 6.基金管型人可以在连急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目前 依照《信息披露办法》的有关规定在指定操入上公告。 7.基金管型人可以在不远远待往规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,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,在对存量基金份额持有 人利益无实质不利率响的前便于,基金管理人口以对销售费率实行一空的优惠。 8.当本基金各类份额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起避婚相关法律法规以及监管部门,自律规则的规定。

: 具体处理原则与操作规心遵循性大法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 (七)拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受全部或部分份额类别的申购申请: 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

1、因不可抗力导致基金元法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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,终与基金托管人协商确认后,基金管理人 当暂停接受基金申购申请 3、证券,期货交易所交易时向非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理申购业务。 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金分额持有人利益或对存量基金分额持有人利益构成

潜在虽大不利影响时。 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,或发生 其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

潜在重大不測影响时,
5. 基金资产规则过大,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,或发生其他损害观有基金份额持有人利益的情形。
6. 基金管理人、基金任管人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金设记系统、基金设计系统等无法正常运行。
7. 制效编制单位应请报效允相,构因异常情况使得效级形式正常计算,计算错误或发布异常时。
8. 基金管理人提及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%,或者更根规则应。集中度的特形时。
9. 在基金管理人技定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%,或者更根规则应。集中度的特形时。
9. 在基金管理人技定或某些申购申请和可能导致单一投资者自和介或单笔申购金额设置上限的情况下,接受基础或某些申购申请超可的法实现或全部上限比例的。
10. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上还能12.33.56.7 1.0项情形之一日基金管理人决定暂停申购时,基金管理人这当根据有关规定在指定域介上引移管停申购公告,如果投资人的中期申请全部或部分验据拒绝的,被拒绝的申购款项本金格退还给投资人。在暂停申购的转点消除的其金管理人不能支付赎回款项。
(人) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形发生了预度的分别。
(人) 有停赎回或延缓支付赎回款项的情形。
发生工场全的规划实的暂停基金资产的信息公务分衡类别的赎回申请或延缓支付赎回款项或暂停接受基金款回申请。
2. 发生基金合间规定的暂停基金资产价值情况即。当前一估值日基金资产净值的可以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用价值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金统产净值或无法办理赎回业务。
3. 证券 到的交易所交更是金资产的情值情况。
2. 发生基金合间规定的转序是全量被资产的最低情形。
发生基金合间规定的特别或主要的最低的特别。
3. 证券 到的交易所交更上最级的时间,每级全管理人还经未被使了成的有可以是被将的影响,基金管理人是全管理人是全价额得有人和能的情形的。
发生是全价额价值的依据计算疑回由申请,基金管理人应及时恢复,是一种原述回时的可事先还操作等目可能未获受理那分产的通情,在暂停赎回的情况消除的,基金管理人应及时恢复,此处别的则用不必需。

1、巨额赎回的认定 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隙 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

響率由是水八公三列延朔沙州即中县任何足殊了上門並公官。 (4)暫停城市,连续2个形成日以上(6本數)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。

28映60时3公宫 生上还巨额赎回开延期办理时,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(包括但 包信,电子邮件或由基金销售机构通知等方式)在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同 起纳上刊受公告。)暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1,发生上述暂停申购或赎回的况的,基金管到人应于规定则限内在指定媒介上刊發暂停公告。 2.基金管型人可以根据暂停申购或赎回的的间。依照《信息披露办法》的有关规定, 版尽于重新开放日在指定介上刊受量部下放中购或赎回的的间。届不用另行没有证额并放的公告。 任何,基金转换 基金管型人可以根据相关法律法规以及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按换业务,基金转换可以收收一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定定并公告,并提前告知基金任管人与相关机构。 (十二)基金的非交易过户 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、从可,符合法律法规的基官非多别过户。或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无在上述何种情心下,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,或者按照相关法律法规或家有权机关要求的方式进行处理的行为。无在上述何种情心下,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,或者按照相关法律法规或家有权机关要求的方式进行处理的行为。无在上述何种情心下,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,或者按照相关法律法规或家有权机关要求的方式进行处理的行为。无在上述何种情心下,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,或者按照相关法律法规或家有权机关要求的方式进行处理的行为。

在上述何种情况下,接受则转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人,或者按照相关法律法规或 家有权机去要求的方式进行处理。 條派是指基金份額持有人死亡,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 有的基金份額捐购给福利性质的基金企政社会团体,司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份額 有人持有的基金份额强制则投资其他信然、法人或其他组织、办理非专员过了必须提供基金登记机构要求提 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。 (十三)基金的转托管 (十二) 建立印程订告 基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收

与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。 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 别用状态评估。 规则。 (十六)基金份鄉持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人经与基金托管人协商一致,可对基金份鄉进 (第一本灣召开基金份鄉持有人大会审议。 (十七)基金份鄉持村人大会审议。 (十七)基金份鄉持村人大会审议。 (十七)基金份鄉持社 在法律法規允许且条件具备份情况下,基金管理人可受理基金份鄉持有人通过中国证监会认可的交易场所成 宏质方式进行基金份鄉转让的申请并由發记机构办理基金份鄉的过户發记。基金管理人报受理基金份鄉转让业 5.将提前公告,基金份鄉持有人应根期基金管理人公告的业务规则办理基金份鄉村企业多。 (十八)其他

(十八)其他 当技术条件成熟。本基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的的据下,经与基金托管人协商一致且履行遇当程序后,可根据具体情况对上还申购和赎回的安排进行补充和调整。或者安排本基金合则人推出最级的一类或多类基金份额作证券交易所上市交易,申购和赎回。成者为理基金份额的收止,过户等业务。若将来本基金管理人相比跟原间一条的指数的交易型开放式指数基金(ETF),则基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前数个方。 法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提全信为。 (基金分级联定FF 联接基金模式运作并相应修改 基金允许。) (基金分级联定FF 联接基金模式运作并相应修改 基金允许。) 人。基金的投资)投资目标

1—17.20 (148) 本基础的投资范围主要包括陈的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标。本基金证可投资于非 股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证金会作计基金投资的股票,(债券。包括国债、金融债券、金业 次、创资券、央户污票则,中则需则,规则融资券。截处即确资券、或效债券、规度支持补偿债券,也方成价债券。 收债券、消转抢债券等),资产支持证券、债券问题,即业产单、银行存款、包括定期存款、协议存款及其他银行 、设计市场工品、金融价生品、包括权证、股利期货)及法律未成现中国证债金允许基金投资的真值金融行。 136上14、建酸17±m1、15m17×m、wi-merch 中国证监会科技规定)。 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,本基金可将其纳人投资

范围。 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及各 选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终,在取除股捐明货合约需缴纳的交易保证金后,本基 全将持有不低于基金资产净值6%的观金或者到即日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金,存出保 证金,应收申购款等,较证,股捐明股及其他金融工具的投资比例依据指法共废或监管机构的规定执行。 本基金参与股捐明投资易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关明货交易所的业务规

(三)投资策略 本基金采用完全复制标的捐数的方法,进行被动式捐数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的捐数的成 股组成及其权重来积合复制标的捐数,并根据标的捐数成的股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪 的指数。本基金紧密跟踪必须性比较基准,追求跟踪偏感家和跟踪误差的最小化。 由于标的捐数编制方法调整,成份股及其权重发生变化(包括配送股,增发,临时调人及调出成份股等)的原。 "成对基金的申喇和联回等对本基金跟踪标的指数的效果可能并来影响力,成因某些特殊情况导致流力性不足 "成对基金的申喇和联回等对本基金跟踪标的指数的效果可能并来影响力,或因某些特殊情况导致流力性不足 "成其值的因导致无法有效复制和跟踪标的捐数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求 在缓骤容温率。"

觀察误差。 1、大裝资产配置 本基金管理人主要按照标的捐数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据捐数成份股及其权重的变 进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%,投资于标的捐数成份股及备选成份股,例不低于基金资产净值的90%;本基金每个交易日日终在扣除股捐期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保低于基金资产净值8%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 。 的指数的方法,按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合

· A基並未用元主复制的31개級以57点。依然特別1개級以57次24以及長校里的建設率及收益15 由于取時報自 51-5环的指数组合物建存在差別,若加製效分解於的情况(例如成份保障用、股票流が此下无足以及其他影响数 被果的因素),本基金将采用包括替代,抽样等技术手段在内的优化复制法来构建组合,使得揭露组合尽可能 [于全复制组合,以减少对标的指数的摄踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资 (例不低于基金资产约80%的比例限制,并符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资 (例不低于基金资产约80%的比例限制,并符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资 目合将根据标的捐数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律 回变动情况等,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准捐数间的高度正

法规中的投资比例限制、申购赎回 相关和跟踪误差最小化。 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

根網床的指数的調整規則和备选股票的預期,对股票投資组合及时进行调整。
2) 不定期調整
A 当成份股发生耐送股、增发。临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权值变化及时调整股票投资组合。B. 根德本基金的中與和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;
C. 根据法律,法规和基金合同的规定,成份股仓标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行信息空通相调整,对非常低源能减少。
在正常市场情况下,力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%。年期继续差不超过4。如阳和数编制规则调整或其他双景中或即紧偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度。跟踪误差进一步扩大。
3.债券格份管路

3.债券投资策略 木基金佛券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微速。 观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资,通过主要采取组合久期配置策略,同时轴之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4. 权证投资策略 本基金格权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值。发现市场对股票权证的非理性定价,利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。 5. 货产支持证券投资强助 5. 货产支持证券投资强加 发现产支持证券投资强加 发展之间,在严格控制风险。充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下。谨慎选择风险调整 对货产支持证券的合理运价。在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下。谨慎选择风险调整

《益较高的品种进行投资。 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 投资策略 6.股指則货投资策略 本基金公套即採值为目的,参与股指則货交易。 本基金参与股指即货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础 基金管理人将根据宏观经济因素,政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金 基本结结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指销货交易的投资比例。

8.其他 未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的 2.相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。 (四)投资决策依据及程序 1.投资决策依据及程序 1.投资决策依据及程序 (2) 版付据效的编制方法及则器公告等; (3) 对证券市场发展趋势的研究与判断。 2.粉涂出策约器 ,投资决集渐程 1) 基金经理依据标的指数成份股名单及权重,进行投资组合构建、 2) 当发生以下情况时,基金管理人将对投资组合进行调整,以降低限踪误差,实现对标的指数的紧密跟踪。 用数编制方法发生变更,基金管理人将作品数编制方法变更对指数成份股及权重的影响,适时进行投资 了指数或师司方法女王安里。基立言理人特许的国家师司方法安更为指数成时成及处理的影响,语识近行及多组合调整。 相合调整。 力,指数成份般定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案,并判断指数成份股调整对投资组合 的影响,在此场船定增强性合调整策略。

此基础上确定组合调整领略。 比基础上确定组合调整领略。 取成份股出现股本变化,增发,配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的膨 引,捐权从切取企业或企业。 ,并能让确定相应的投资组合则整整础。 4)当因法律法规限制本基金不能投资捐数成份股时,基金管理人研究制定成份股替代策略,并适时进行组合 。 5) 基金参与新股申购、股票长期停牌、股票流动性不足等情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影 5)基金参与前欧甲粉、欧米、以河下、35%、35%。 响,提此对皮型倍进行相应调整。 (3)金融工程即对基金的口帮投资和交易是否遵守法律法规、基金合同进行独立监督检查;并定期对投资组合的跟踪误差进行限原料即后,提供基金经理参考; (4)基金经理参考有关的实践告及投资风险管理部的报告,及时进行投资组合调整。

(五)标的指数与业绩比较基准 *基全的标码均数为MSCI中国A股消费指数(MSCI China A Consumer Discretionary and Cons

本基並的型域比较結准分: MSCI中国A股消费指数收益率×96%+银行人民币活期存款利率(税后)×5% MSCI中国A股消费指数是由全球者名的消费性应商原根上月利费本国际公司(Morgan Stanley Capital mational,MSCI 海၏的膨胀中国总量协造的接行业表现的增数、MSCI中国A股消费指数具有市场代表性强、 鐵制方法透明等待定。能够较好的反映中国点股市场消费行业总体及废趋势。银行人民币活期存款利率(税 捐申国人民银行公仲并从行的范围金融制均、民币存款基本股后利率。本基金参考规则的大类资产配置的

10.13至16日7以組。 数提供商空更或者指数提供商停止编制上述标的指数,或者上述标的指数由其它指数代替,或者因客 致指数无法编制,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变

观原以等导致函数无宏测则,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的东的指数,基金各作与业绩比较基准。 若变更标的指数(及相应变更业绩比较基准)涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更,则基金管理人 应就变更标的指数(及相应变更业绩比较基准)沿开基金份额持有人大会,并换中国证监会备案且及时在指定模 个上刊登公告。若变更标的指数及业绩比较基准)召开基金份额持有人大会,并换中国证监会备案且及时在指定模 名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,并应及时在指定域 指定蜗个上公告。

/ 、 / 、 / ハール / ハ

(9)本基金管理人管理的全部基金投资于同一购购权益人的各类员产义疗证券,个种稳以具有类对下公扣证计规模的10%; (10)本基金放投资于信用级期评级为5BB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 用等级下降、再将令投资标准。应在评级权是按允之目起3个月内产以全%要出; (11)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 拟发行股票公司本义发行股票的总量; (12)本基金进入全国银行间间业市场进行债务问购的资金会额不得超过基金资产净值的40%,本基金在全 行间间业市场的统制的调局长期限为1年。债券的图如间后不得原明; (13)本基金金任何交易日日终,持有的买入股市财货合约价值不得超过基金资产净值的10%; 2)在任何交易日日终,持有的买入股市财货合约价值不得超过基金资产净值的10%; 2)在任何交易日日终,持有的买入股市财货合约价值不得超过基金资产净值的10%,不够还可以多别日级。有的买入股市财货合约价值不得超过基金资产净值的10%, (4)价值为销股票、债券(不含到明日在一年以内的政府债券),仅证、资产支持证券。买入返售金融资产(不含 或订购)等。

原押式回傳)等。 3)在任何之場日終,持有的卖出股捐期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%; 4)本基金所持有的股票市值和买人、卖出股捐期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例应当符合

5)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%; (14)本基金总金总资产不得超过基金净资产的140%; (14)本基金总金资产不得超过基金净资产的140%; (15)本基金主动收资平流动性受限资产的計值合计上不得超过该基金资产净值的15%。因证券市场被动、上市公司股票停户,基金主动收资平均基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定比例限制的,基金管理人不得主动销增流动使受限资产的投资; (16)本基金与系统系统企业系统等的发现。 (17)本基金与系统系统设计系统 (18)本规则 (17)本基金投资流源受限证券,基金管理人应当先根据中国证监会相关规定,与基金托管人 在本基金托管协议中明高基金投资流源受限证券,基金管理人应当先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明高基金投资流源受限证券,基金管理人应到了严格的投资决策流程和风险控制制度,防范统分整构、现场实验验的不多条构和处。 (18)法律法规及中国证监会规定的和(基金合同)约定的线由性投资限制。 (18)法律法规及中国证监会规定的和(基金合同)约定的线由性投资限制。 (18)法律法规及中国证监会规定的和(基金合同)约定的线由性投资限制。 能上法规之证明的成分统约完全规划的和(国金合同)约定的线由他投资限制。 能上基第(2)、(10)、(15)、(16)、项外、因证券、财政市场运动,证券发行入合并,基金规模变动,标的指数成份被动产限制等基金管理人应当日基金合同的大约成务,对该市场运动,证券发行入合并,基金规模变动,标的指数成份被动产限制等基金管理人之外的技术的发展的关键,是全管理人应当日基金合同处于发生之的关键。

。 加法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,本基金在符合法律法规和基金合同的约定,且履行适当 并提前公告后,可不受上述规定的限制,或以变更后的规定为准。

知法律法规应监管部门取削或处理上处率正比处观。外部现在19 日本中的特别,或以变更后的规定为准。
2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1) 派申证券。
(2) 违反规定的他人贷款或者提供担保。
(3) 从事承担无限责任的投资。
(4) 买卖 性结基金份额。
(5) 向其基金管型人,基金柱管人出资;
(6) 从事事榜交易,绝知来交易价格及其他不正当价证券交易活动;
(7) 法律。行政法规和中国证监会是有规定的除外。
(6) 从事事榜交易,绝对来交易价格及其他不正当价证券交易活动;
(7) 法律。行政法规和中国证监会规定禁止的其他压动。
基金管理人,基金柱管人,基金柱管人从基本程度人及其控股股份。实际控制人或者与其有重大利害关系的公司效行的证券或者深削即内承销的证券,或者从事其他重大关键交易形,应当符合基金的投资目标和投资策备。遗憾基金价税持有人利益作从原则,第六时总经中发生人对各个人是全的发生的工程和投资策合,或者从事其他重大关键交易的,应当符合基金的投资目标和投资策合,或者或者将削印办承销的证券,或者从事其他重大关键交易的,应当符合基金的投资目标和投资策合,如其实行的此等或者深削即办案制制基金柱管人的问题;并经法律法规于以按照、重大关键交易必须等先得全部分量分全用价格,还有一个之一以上的股近省事场进入基金营业人企业人是的股近省事场过,基金管理、经验上有关键交易的基本基金管理人重要各种人的影点,是全是是不是一个是一段的现在影响,基上传行为规定的条件和要求进行变更的,经与基金柱管人协商一致,基金管理人可在履行通经产的资格金合同进行变更。
(八) 基金管理人代表基金管行投股东权利及假以上股票国际专人现在代表基金会处立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益。
4、基金管理人权限国际有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益。
4、基金管理人权限国际有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益。
4、基金管理人权限国际有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益。
4、基金管理人权限国际有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益。

一、基金的财产 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。 (二)基金资产单值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。 權並以「中國起用國際。」 (三)基金財产的账户 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 的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、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

字账户相辩立。 (四)基金财产独立于基金管理、基金社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 本基金财产独立于基金管理、基金社管人和基金销售机构的财产承担其自身的法律责任,其做权人不得对本基金财产行使 请求冻结,排呼或其他权利。除依法律法原和《基金合同》的规定处分外、基金财产不得被处分。 基金管理人、基金管理人管理设计。 海金管理人、基金管理人管理设计基金财产生的债权。 海等财产基金管理人管理运作基金财产产生的债权。

基金所拥有的股票、债券、金融衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

十一、基金资产的估值

基金所拥有的股票、债券。金融行生品和银行存款本息、应收款项。其它投资等资产及负债。
(三) 估值方法
1、证券交易所上市的有价证券的结值
(1) 交易所上市的有价证券的结值
(1) 交易所上市的有价证券的结值
(1) 交易所上市的有价证券的结值
(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值,估值
日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收金价) 行值。如题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,可参考类假设高种的银行市及重大变化因素,调整最近交易用仓品企业分价格。
(2) 交易所上市交易应建建牌转让的固定收益品种(基金合同对有规定的废外),选取信值日第三方估值机构提供的相应总的结合种价估值,每是还要另一层全管理人与扩展分别。2 包裹所上市交易的可转换债券,投估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的多价近年(在值、估值已没有受易的,是更交易日上经济环境未发生重大变化及是近交易日传动势收盘价或分价中所含的债券应收利息得到的争价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现分市份发生产业记录,跟整最近交易用价值。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类行市价及重大变化因素,跟整最近交易用价价。确定公允价格。
交易所上市实行全价交易的债券(司转债除外),选取第三方估值机构建供的估值全价减去估值。
(4)对在交易所市场建牌转让的资产支持证券和私募证券,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价值。如成本准等近似体现公允价值、应持续评估。

2.处于未上市期间的有价证券成区分如下情况处理: (1) 这股,转磨股, 配股和公开膛垫的股票, 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 部的,以最近一目的市价(收盘价) 估值。 (2) 直次公开发行来上市时级票、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 3.7 接成本行政17年上市成末挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,起以活跃市场上未经调整的银价作为计量目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,确认计量目的公允价值;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

; i)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 难以可靠计量公会价值的情况下,按成本进行估值, 值技术难以 《公元》「旭印)[60.17,按风平进行161组; \$股指期徐合约。——即以估值当日结管价进行估值,估值当日无结管价的,日最近交易日后经落

按照下达规定执行。 由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。 (一个) 其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。 2、信值错误处理原则 (1) 恰值错误已发生,信尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调务方,及时进行更正,因更正 销龄发生的费用由估值错误责任方承起;由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 (时) 由估值错误责任方对量极快,乘恒赐偿责任;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 这等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 和、确保估值销证是得到更正。

有足够的时间进行理正而未更正,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。
(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。不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责。如果由于获得不当得利的当事人负责及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍成应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人心是依然还不当得利的义务。但估值错误责任方的制度受抗方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对疾得不当得利的方面当有其一些特别的原则,则更成为应当有其已经获得的分别的股利,则更成为应当有其已经获得的分别的股利,则更成为应当有其已经获得的解偿额加上已经获得的不当得利的当事人已经将此部分不当得利应还免受损力,则受损力应当有其已经获得的保持,但一定经关键的不当得利应还的总利超过其实际损免决差额的少支付给估值错误责任方。
(4)估值错误地解决,并未提出估值错误为定于的原因,确定估定,在借替误处理规则或当事人的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下。
(1)查明估值错误处理规则或当事人协商的方法对因估值错误也无进行评估;
(2)根据估值错误处理规则或当事人协商的方法对因估值错误进行进行提下和解偿损失;
(4)根据估值错误处理则的方法。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的有关当事人法许确认。
4、基金价额净值估值错误对,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金任管人,并采取合理的措施的止损失进一步扩大。

一步扩大。 ?)错误偏差达到该类基金份额净值的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 2) 错误偏差达到该类基金份额净值的2.28%时,基金管理人应当通报基金托管人并积中国证监会备案;错误 到该类基金份额净值的6.5%时,基金管理人应当公告,通报基金托管人并报中国证监会备案。 3) 前述内容如法律法规或监管机关户有规定的,从其规定处理, ,) 暂停住值的情形。 ,基金校资所涉及的证券,期货交易市场通法定节假日或因其他原因暂停营业时; ,据全校资所涉及的证券,期货交易市场通法定节假日或及其他原因暂停营业时; ,出名位的实践也情形较健基金管理人,基金托管人无法体确学估基金资产价值时; ,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 正据大不确定性时,然与基金托管人协商一致的; ,法律法规,中国证监会和基金合同认定的其它情形。

4.法律法與、中国证監会和基金合同从定的其它情形。 (七)基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和各类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。 基金管理人以下每个估值已要熟结束后计算当目的基金资产净值和各类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净值予以公布。 (八)特殊情形的处理 基金管理人人 基金托管人按估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。 由于证券,则按交易所及登记结算公司发送的数据错误。或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人 虽然已经承收必要,通当人每即销插进行检查。但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十二、基金的收益分配 (一)基金利润的构成 基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益 金利润减去公允价值变动收益后的余额。 (二)基金可供分配利润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。

基並可形分化利油耐酸主收益方定基础自由基立水方能利润与末次扩配利润中二次规模战机或或。 (三)基金收益补免限制。 大在符合有关基金分红条件的前捷下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供外配利润的10%。若《基金合同》上数不满2个月可不进行收益分配。 2、基金收益分配方式分为两种。现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相 边类则的基金份额进行再投资,若投资者不选择。本基金张从的或分量方式是现金分红、若投资者选择红利再投资。 资方式进行收益分配,基金管理人将按除权除息目的各类基金份额净值将投资者的现金红利转为相应类别的基金

资方式进行收益分配,基金管理人特按除股度目的各类基金份额净值将投资者的现金红利转为相应类别的基金份额进行规分。
3.基金收益分配与系类基金份额净值均不能低于面值,即基金收益分配基准目的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收查分配金额后不能低于面值;
4.同一类别的每份基金份额享有同等分配权,由于本基金各类基金份额收取费用情况不同,各基金份额类别对应的可供分配利油将有所不同;
5.法律法规应监管制定为有规定的,从其规定。
在对基金份额持有人利益无实质不利能平的情况下。基金管理人可在法律法规允许的前提下与基金托管人协商一致并按照监管部门现实服行适当程序后的情调整以上基金收益分配原则,此项调整不需要召开基金份额持有人大会审议、但应于变更实施目前在指定媒介公告。
(四)收益分配方案 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。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同,基金管理人可相应制定不同的收益分配方

(五)收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监

会备案。 基金配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。 (六)基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时房生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承租。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,基金登记机何可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金 份额。红利再投资的计算方法,依照(业务规则)执行。 十二、基金的费用与6秒收 (一)基金费用的种类 1、基金管理人的管理表

、議宣官理人的管理致; 、議查社官人的任管教; 、销售服务费; (、基金合同》生效后的标的指数许可使用费; (、基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; (、基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费; 、基金的部将和大公金费用; 、基金的部将和大公费用;

、基金的银行工则使用。 6、账户开户费用、账户维护费用: 6、账户开户费用、账户维护费用: 1、投照国家有关规定和(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 二)基金费用计能方法、计提标准和支付方式

、一)基立政州下郊力法、下途等部外区划力式、 ,基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下: 1-5 E S S O S · 当年天教 打为每日应计提的基金管理费

日內,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按指令。若遇法定节 抗力等。支付日期顺延。 2.基金托管2.保护管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=BN0.10% = 当年天数

H=E×0.10%。当年天數 H为每日应计提的基金托管费 比为前一日的基金资产单值 基金托管费每日计划,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,自动在月初5个工作 日内,按照附近的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划按指令。若遇法定节假日、休息日或不可 抗力等,支付日期间延。 3. C米基在价量的增生配14.5m

(內,我們相似的歌戶時位就打算或文句,據查言導入死而再出與實並別級相等。石灣成是日顯白、休息日與不明,力等,交付日期随延。
3.(次基益分衡前時服务费。
3.(次基益分衡前時服务费,仅就欠基益分额收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务按前一日该类基金份额条金资产单值的0.20%的年费率计划。销售服务费的计算方法如下:
日 下0.00%。当年天数日,为了大量是全分额的中国的基金资产单值的2.00%的年费率计划。销售服务费的计算方法如下:
日 为次基基金份额每日应计量的销售服务费日,以为企業基金份额的一目的基金资产净值销售服务费每日计量,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1,自动在月初5个工作日内,按照指定的除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,由登记机代收、货记机构收到后按相关合间规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日间延

《基金合同》生效后的标的指数许可使用数按照基金管理人与指数提供商签署的指数使用许可协议的约定 从基金树产中向指数提供商支付、标的指数许可使用数按前一日基金资产净值0.02%的年费案计据。具体计数方法

如下;

H=E×0.02%+当年天教
H为每日应计划的标的指数许可使用费
H为每日应计划的标的指数许可使用费
E为本基金前一日的基金资产净值
旅的指数许可使用费的收取下限为每季度5000美元或等值人民币(即不足5000美元时按照5000美元或等值人民币(即不足5000美元时按照5000美元或等值人民币收取),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计

(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列人基金费用。
下列费用不列人基金费用。
1.基金管理人和基金托管人因未履行成未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
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;
3.《基金合同》生效前的相关费用;
4.提他根则相关法律法规及中面监督会的有关规定不得列人基金费用的项目。
(四)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况,在按照法律法规和《基金合同》的要求履行适当程序现整基金管理人和基金特普费率和基金销售服务费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率他目前在指定媒介刊登公告。
(五)基金数

(五)基金粉收 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律、法规执行。 基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人条担。基金管理人或者其他和撤义务人按照国家有关税收征收 的规定代和代缴。 十四、基金的会计与审计 十四、基金的会计与审计
(一)基金会计政策
1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;
2.基金的会计年度为公历年度的1月:1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则;如果《基金合同》
生效心于2个月,可以并入下一会計年度披露;
3.基金核算以人民币为记账本位而,以人民币元为记账单位;
4.会计制度执行国家并关注针制度;

以衣; '、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核篇、报表编制等以双方认可的方式进行核对并确认。

(二)基金的年度审计 (二)基金管理人制调与基金管理人,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。 2.会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。 3.基金管理人认为有先理相更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒 介公告并报中国证监会备案。

与并报中国证监会备案。 ── 一)本基金的信息披露 ──)本基金的信息披露应符合《基金法》《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金 及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时,本基金从

新規定。 (二)信息披露义务人 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法

中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。 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

系出36年又下。 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘 要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。 t.基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定

· 基础空间》:实验后,记于宋沙宁进建立以商中四级和罗应山内,建立会是人公司主义。 《公司》: 和各类基金份额中值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以 及其他媒介,披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。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、各类基金份额净值和各类基金份额累计净值登载在指定媒介

5.各类基金份额申购,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裁明各类基金份额申购,赎回价格的计算方式 发有关申购,赎回费率,并保证投资者能够在基金份额发售网点资值或者复制前述信息资料。 6.基金定期报告,包括基金企度报告,据基金学度报告,据金经股报告, 基金管理人应当在每年结束之日起30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 报告被要整成在指定域介上。基金定规指的财务会计报货已当经过申归。 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网站上, 经生产股报与线面网络查拉斯域外。

介上。
《基金台司》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者生度报告。基金定期报告在公开披露的第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场备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。
基金管理人应当在基金定期产业定报告和单年度报告中被露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。
报告期内出现单一投资者持有基金份额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,基金管理人至少这一在基金定期程于影响投资者决策的基础重要信息。现于披露该投资者的类别,报告期末持有份额及比。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。

3)转换基金运作方式。
1) 更换基金运作方式。
2) 更换基金管理人、基金托管人的法定名称、往所发生变更;
3) 基金管理人、基金托管人的法定名称、往所发生变更;
3) 基金管理人。基金托管人的法定名称、往所发生变更;
4) 基金管理人的重导化,总量是以他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
4) 基金管理人的董事化一年序变更超过百分之五十。
4) 基金管理人的董事化一年序变更超过百分之五十。
11 涉及基金管理儿的董事化一年序变更超过百分之五十。
11 涉及基金管理儿外。基金社管《基金托管部》的中主要则多人员在一年内变动超过百分之三十;
11 涉及基金管理儿及,基金性《基金托管》以为"以金宝"和"人基合并管"人类型监管部门的调查。
13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金

(11) 涉及基金管理型等,基金制产。基金社管型等的环体取者甲酸;
(12) 基金管理人及其董事。总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及
附了负责人受严重行政处罚。
(14) 国大关联交易事项;
(14) 国大关联交易事项;
(15) 基金收益分配事项;
(16) 管理费,托管费,增出服务费、标的指数许可使用费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
(17) 管理费,托管费,增出服务费、标的指数许可使用费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
(18) 基金政制会计师事务所;
(19) 变更基金价额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;
(19) 变更基金价额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;
(20) 更基金总记机构;
(21) 本基金开始为理申购,赎回;
(22) 本基金中则,赎回;
(23) 本基金发生巨额赎回并延期办理;
(24) 本基金查接发生巨额赎回并延期办理;
(24) 本基金查接发生巨额赎回并延期办理;

○ (成用公百) 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生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团对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报

10、基金投资股指期货的信息披露 着本基金投资了股捐期货。需按照法规要求在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更 等文件中或额股捐期货交易情况、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。

对基亚亚特风险的影响以及避免行言协定的投资政政和投资自参等。 11.基金投资产资产连转证券,需按照法规要求在季度报告,半年度报告,年度报告等定期报告和招募说明书 (更新)等文件中披露资产支持证券的交易情况。基金管理人应在基金年报及半年报中披露其材有的资产支持证 券急额、资产支持证券和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,在基金季度报告中披露其 持有的资产支持证券经额。资产支持证券中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名资产支持证券钟细。

(23) A-彝蓝 文生已鄉縣回升延邦於2里; 24) 本基金建設生已鄉縣回井舊序接受赎回申请; 25) 本基金管學接受申賴, 號回申请三銀新接受申與, 號回; 26) 发生涉及基金申與, 號回申前三銀新發達養主縣時投资者赎回等重大事項时; 27) 基金管理人采用經动定价机制进行估值;

国证监会。 9.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备案,并予以公告。

、不可机力; !、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;

十六,风险揭示 本基金的风险主要包括:市场风险,信用风险,管理风险,流动性风险,操作和技术风险,合规性风险,股指期货风险,本基金转有的风险,本基金法律文件风险收益转征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及

广主成功,从110年政会主化成小个在工文化,广土从22。主义671从22亿条 25台: 1. 政策风险 因财政政策,货币政策,产业政策,地区发展政策等国家宏观政策发生变化,导致市场价格被动,影响基金收益 生风险。

公室所周期风险 随着经济运行的周期性变化,证券市场的收益水平也呈周期性变化,基金投资的收益水平也会随之变化,从而 产生风险。
3.利率风险
3.利率风险
6.融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率,影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票,其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4、上市公司经官风险 上市公司的经营状况受多种因素的影响,如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究 开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善、其职票价格可能下跌,或者能够用于分 配的利润减少,使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散

投资风险。本基金符号IDIANE、作品的ANNA, 使比风险等。 (一)市场风险 基金主要投资于证券市场,而证券市场价格因受到经济因素,政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的能 响而产生波动,从而导致基金收益水平发生变化,产生风险。主要的风险因素包括:

3、发生基金合同约定的暂停估值的情形; 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

29)调整基金份额类别设置; 30)中国证监会规定的其他事项。

平及报台揭安豆氧任恒疋架介工。 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

5、各类基金份额申购、赎回价格

计制度: