(上接A15版)

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、赎回或者转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

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;

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;

3、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;

4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

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。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须在规定的时间内全额交付申购款项,投资人交付款项,申购申请即为成立,否则所提交的申购申请不成立。登记机构确认基金份额时,申购生效。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的销售机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人,由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人在提交赎回申请时,须持有足够的基金份额余额,否则所提交的赎回申请无效;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。

基金份额持有人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

遇证券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时,赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生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。

3、申购和赎回申请的确认

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)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与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,投资者应及时查询。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人首次购买本基金的最低金额为10元(含申购费),追加购买单笔最低金额为10元(含申购费);详情请见当地销售机构公告;

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为10份,单笔赎回申请不得低于10份;若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于10份时,余额部分基金份额必须一同赎回;

3、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制,基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制,具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告;

4、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,具体规定请参见定期更新的招募说明书或相关公告。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,具体规定请参见定期更新的招募说明书或相关公告。

5、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。

六、申购份额与赎回金额的计算方式

1、本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2、申购费率和申购份额的计算

本基金A类基金份额在申购时收取申购费用,C类基金份额不收取申购费用。

本基金的基金份额申购费率最高不超过1.20%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示:

申购金额(M)	A类基金份额的申购费率
M<50万	1.20%
50万≤M<100万	0.80%
100万≤M<500万	0.50%
500万≤M	每笔1000元

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,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基金财产承担。

本基金申购份额的计算方法如下:

(1)适用于比例费率

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为:

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/申购当日基金份额净值

(2)适用于固定费用

净申购金额=申购金额-固定申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

例:某投资人投资10万元申购本基金A类基金份额,对应申购费率为1.20%,假设申购当日A类基金份额净值为1.0160元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额=100000/(1+1.20%)=98814.23元

申购费用=100000-98814.23=1185.77元

申购份额=98814.23/1.0160=97258.10份

例:某投资者投资10万元申购本基金C类基金份额,假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元,则可得到的申购份额为:

申购份额=100,000/1.0500=95,238.10份

申购费用由投资人承担,不列入基金财产。

3、赎回费率和赎回金额的计算

本基金赎回费率最高不超过1.50%,随申请份额持有时间增加而递减。如下表所示:

A类基金份额持有时间(Y)	A类基金份额赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<30天	0.75%
7天≤Y<6个月	0.50%
6个月≤Y	0
C类基金份额持有时间(Y)	C类基金份额赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<30天	0.10%
30天≤Y	0

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日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基金财产承担。

在本基金的赎回金额的计算公式为:

赎回费用=赎回份额×赎回当日的基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×赎回当日的基金份额净值—赎回费用

例:某投资人申购本基金的基金份额且持有3日再赎回10万份,假设赎回费率为1.50%,假设该部分基金份额净值是1.0170元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用=100000×1.0170×1.50%=1525.50元

赎回金额=100000×1.0170-1525.50=100174.50元

例:某投资人申购本基金C类基金份额且持有25日再赎回10万份,赎回费率为0.1%,假设赎回当日C类基金份额净值是1.2130元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用=121,300.00×0.10%=123.00元

赎回金额=100,000×1.2130-123.00=12177.00元

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。对持续持有期少于30日的投资人,赎回费全额计入基金财产;对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人,将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期不少于6个月的投资人,应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。(注:1个月以30日计算)

6、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。

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,基金管理人可以适当调低基金申购费率。

8、当本基金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投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。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。

3、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。

4、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。

5、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(基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购基金份额的情形除外)。

6、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。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、6、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。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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赎回申请。

3、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。

4、基金管理人继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时,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。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。

九、巨额赎回的情形及处理方式

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)超过前一工作日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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或部分延期赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人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。

(2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部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。

若发生巨额赎回,对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额10%以上的赎回申请,将自动进行延期办理;对于其余赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日可确认的赎回份额。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(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。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,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,同时在指定媒介上刊登公告。

十、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,并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应根据《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的基金份额净值。

十一、基金转换

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。

十二、基金份额的转让

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据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十三、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。

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构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。

十四、基金的转托管

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取转托管费。

十五、定期定额投资计划

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。

十六、基金的冻结和解冻

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。

基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

十七、基金管理人可在法律法规允许的范围内,在不影响基金份额持有人实质利益的前提下,根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。

二、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款和其他存款)、同业存单、权证、股指期货等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)。

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,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比为90%~95%。其中,本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。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,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、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本基金为指数增强型股票基金,采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。

1、股票投资策略

本基金以中证500指数为标的指数,除跟踪标的指数外,亦可通过成分股权重优化增强和非成分股优选等增强策略对投资组合进行优化,精选个股作为增强股票库,力争在最佳时机选择增强股票库中估值合理,基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置,以获取超额收益。本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。

(1)多因子模型

多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下,股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子,并进而根据因子收益的预测,形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况,在实证检验的基础上,寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子,并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论,对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上,基金管理人将根据市场环境的变化,综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判,适时调整各因子类别的具体组合及权重。

(2)投资组合优化模型

在形成股票投资组合的具体结构时,本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言,根据多因子模型的超额收益预测结果,基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素,通过主动投资组合优化器,构建风险调整后的最优投资组合。

2、债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

3、衍生产品投资策略

(1)权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

(2)股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易,以降低投资组合仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地实现投资目标。

(3)本基金将关注其他金融衍生工具的推出情况,如法律法规或监管机构允许基金投资其他衍生工具,本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定,制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。

4、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性,增强本基金投资的安全性;利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性,在市场出现投资机会时,优先选择股性强的品种。综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资,获取超额收益。同时,关注可转债和可交换债流动性、条款博弈、可转债套利等影响转债及可交换债投资的其他因素。

5、中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券,本基金以持有到期、获得本金和票息收入为主要投资策略,同时,密切关注债券的信用风险变化,力争在控制风险的前提下,获得较高收益。基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后2个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

6、资产支持证券投资策略

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。未来随着证券市场投资工具的发展和丰富,在符合有关法律法规规定的前提下,本基金可相应调整和更新相关投资策略。

7、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,遵循法律法规的规定,在履行适当程序后相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票资产占基金资产的比例为90%~95%。其中,本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;

(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,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期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;

(3)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%;

(4)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%;

(5)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%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)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;

(13)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;

(14)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,债券回购到期后不得展期;

(15)基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十;

(16)基金参与股指期货交易,需遵守下列规定:

1)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%;

2)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指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;

3)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%;

4)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

(17)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;

(18)本基金管理人管理的全部开放式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%;

(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该基金资产净值的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)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)、(13)、(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。

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,或以按调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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他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的原则,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的同意,并按相关法律法规予以披露。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。

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,则本基金投资不再受相关限制,或以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

本基金的标的指数为中证500指数。

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率(税后)×5%

如果法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩基准时,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整基金的业绩比较基准,但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案,并及时公告,无须召开基金份额持有人大会审议。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金,理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数类似的风险收益特征。

七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值;

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

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

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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。开立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产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

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。除依法律法规和《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。

第十一部分 基金资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

基金所拥有的各类有价证券以及银行存款本息、备付金、保证金和其他资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)除本部分另有约定的品种外,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)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定;

(3)交易所上市交易的可转换债券,按照每日收盘价作为估值全价;交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券和私募债券,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。

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、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1)银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2)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固定收益品种,按成本估值。

4、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值,估值技术难以确定和计量其公允价值的,按成本估值。

5、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。

6、股指期货合约的估值方法

(1)评估股指期货合约价值时,应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值。

(2)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。

7、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、自律规则的规定。

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。

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

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失,由基金管理人负责赔付,基金托管人不负责赔付。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,基金份额净值精确到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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1、估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、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。

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。

2、估值错误处理原则

(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。

(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。

(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,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。

(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。

3、估值错误处理程序

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:

(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;

(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;

(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;

(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。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告。

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

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

2)若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,由此给基金份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

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

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

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

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、经与基金托管人协商确认,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,基金管理人应当暂停基金估值;

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

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,由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第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。

2、由于不可抗力,或证券交易所、期货交易所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、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。

第十二部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、C类基金份额的销售服务费;

4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费;

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

6、《基金合同》生效后与基金运作相关的或者为维护基金份额持有人利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

9、基金的证券、期货交易费用;

10、基金的银行汇划费用;

11、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。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.80%÷当年天数

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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数

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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。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。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

销售服务费用可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

4、标的指数许可使用费

《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定,从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。具体计算方法如下:;

H=E×0.016%÷当年天数

H为每日应计提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

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币壹万元(10,000元),计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

如果标的指数许可使用费的计算方法或费率发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告,此项调整无须召开基金份额持有人大会审议。

5、上述"一、基金费用的种类中第5-11项费用",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,由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

6、证券账户开户费用:证券账户开户费由基金管理人先行垫付,自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付给基金管理人,如资产余额不足支付该开户费用,基金托管人不承担垫付开户费用义务。

证券账户开户费的支付,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5个工作日内从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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;

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、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。

四、基金税收

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。

第十三部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种: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;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同,不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

法律法规或监管机构另有规定的,在不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人在履行适当程序后,将对上述基金收益分配政策进行调整。

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。

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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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。

第十四部分 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》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;

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;

4、会计制度执行国家有关会计制度;

5、本基金独立建账、独立核算;

6、基金管理人及基金托管人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;

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或双方约定的其他方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。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。

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露,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。

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:

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;

2、对证券投资业绩进行预测;

3、违规承诺收益或者承担损失;

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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。

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,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、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。

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各自网站上。

(二)基金份额发售公告

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

(三)《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

在《基金合同》生效公告中披露基金管理人及基金管理人股东持有基金的份额。

(四)基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发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。

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。

(五)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。

(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

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。

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。

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。

《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。

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构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

基金管理人应在年度报告、半年度报告、季度报告中分别披露基金管理人及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

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。

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应当在定期报告"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。

(七)临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,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。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

1、基金份额持有人大会的召开;

2、终止《基金合同》;

3、转换基金运作方式;

4、更换基金管理人、基金托管人;

5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;

7、基金募集期延长;

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;

9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;

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百分之三十;

11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁;

12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

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托管部门负责人受到严重行政处罚;

14、重大关联交易事项;

15、基金收益分配事项;

16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

17、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五;

18、基金改聘会计师事务所;

19、变更基金销售机构;

20、更换基金登记机构;

21、本基金开始办理申购、赎回;

22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

23、本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项;

24、本基金暂停接受申购、赎回申请;

25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

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

27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

28、增加或调整基金份额类别;

29、中国证监会规定的其他事项。

(八)澄清公告

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。

(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备案,并予以公告。

(十)投资中小企业私募债券的信息披露

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后2个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

(十一)投资资产支持证券信息披露

基金管理人应当在基金年报及半年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。

基金管理人应当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。

(十二)投资股指期货信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告、基金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。

(十三)投资流通受限证券的信息披露

基金管理公司应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

(十四)中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告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或者以XBRL电子方式复核审查并确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

七、信息披露文件的存放与查阅

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。

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。

八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:

1、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;

2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

3、法律法规规定、基金合同或中国证监会认定的其他情形。

第十六部分 风险揭示

投资者投资于本基金,将承受各种风险,因此在作出投资于本基金的决定之前,应慎重考虑以下所示风险因素。

(一)证券市场风险

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、国有股减持与流通政策等国家经济政策的变化会对证券市场产生影响,导致证券市场价格波动而产生的风险。

2、经济周期风险

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,本基金的投资品种可能发生价格波动,收益水平也会随之变化,从而产生风险。

3、利率风险

利率的变化直接影响着债券的价格和收益率,同时也影响到证券市场资金供求关系,并在一定程度上影响上市公司的盈利水平,上述变化将在一定程度上影响本基金的收益。

4、购买力风险

本基金的利润将主要采取现金形式来分配,而通货膨胀将使现金购买力下降,从而影响基金所产生的实际收益率。

(二)流动性风险

流动性风险指在开放式基金运作过程中,可能会发生基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

1、基金申购、赎回安排

投资人具体参见基金合同"第六部分、基金份额的申购与赎回"和本招募说明书"第八部分、基金份额的申购与赎回",详细了解本基金的申购以及赎回安排。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款和其他存款)、同业存单、权证、股指期货等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)。

上述资产均存在规范的交易场所,运作时间长,市场透明度较高,运作方式规范,历史流动性状况良好,正常情况下能够及时满足基金变现需求,保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下,上述资产可能出现流动性不足,导致基金资产无法变现,从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计,绝大部分时间上述资产流动性充裕,流动性风险可控,当遇到极端市场情况时,基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求,及时启动流动性风险应对措施,保护基金投资者的合法权益。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制,对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时,基金经理和监察稽核部需要根据实际情况进行流动性评估,确认是否可以接受所有赎回申请。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时,需在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金份额净值波动的基础上,审慎接受、确认赎回申请。基金管理人在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,可能采取延期支付部分赎回款项或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的流动性风险管理措施,详见招募说明书"第八部分基金份额的申购与赎回"的相关约定。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商一致,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请进行适度调整。基金管理人可以采取备用的流动性风险管理应对措施,包括但不限于:

(1)暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同"第六部分、基金份额的申购与赎回"中的"八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形"和"九、巨额赎回的情形及处理方式",详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。在此情形下,投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝,同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

(2)延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同"第六部分、基金份额的申购与赎回"中的"八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形"和"九、巨额赎回的情形及处理方式",详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。在此情形下,投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

(3)收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。

(4)暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同"第十四部分、基金资产估值"中的"六、暂停估值的情形",详细了解本基金暂停估值的情形及程序。在此情形下,投资人没有可供参考的基金份额净值,同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受,或被延缓支付赎回款项。

(5)中国证监会认定的其他措施。

(三)信用风险

基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,都可能导致基金资产损失和收益变化,从而产生风险。

(四)管理风险

在基金管理运作过程中,管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断,从而影响基金收益水平。

(五)操作或技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中,可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致的风险,如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

在开放式基金的后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

此外,基金还面临会计风险,其主要包括:基金数据维护风险、基金数据接收风险、基金估值风险等。

(六)本基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资资产支持证券,资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险,本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资。

(1)与基础资产相关的风险主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

(2)与资产支持证券相关的风险主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险。

(3)其他风险主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

(七)本基金投资中小企业私募债的风险

本基金可投资中小企业私募债,中小企业私募债由于发行人自身特点,存在一定的违约风险。同时单只债券发行规模较小,且只能通过沪深两大交易所特定渠道进行转让交易,存在流动性风险。

(八)基金管理职责终止风险

因违法经营或者出现重大风险等情况,可能发生基金管理人被依法取消基金管理资格或被依法解散、依法撤销或被依法宣告破产等情况,在基金管理人职责终止情况下,投资者面临基金管理人变更或基金合同终止的风险。

基金管理人职责终止涉及基金管理人、临时基金管理人、新任基金管理人之间责任划分的,相关基金管理人应对各自履职行为依法承担责任。

(九)本基金的特定风险

1、与指数化投资方式相关的特有风险。

本基金为指数增强型的股票基金,以追踪标的指数为投资目标,在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

(1)系统性风险

本基金为股票型基金,绝大部分基金财产投资于标的指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中,本基金可能面临标的指数成份股以及备选股所具有的特有风险,也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采取指数化投资策略,被动跟踪标的指数。为实现投资目标,当基础市场下跌而导致标的指数成份股发生系统性的下跌时,本基金不会采取防守策略,由此可能对基金资产价值产生不利影响。

(2)投资替代风险

因特殊情况(比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,由此可能对基金产生不利影响。

(3)与标的指数相关的风险

1)标的指数变更风险

根据基金合同约定,若出现指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金可能变更标的指数,届时基金的投资组合将随之调整,基金的收益风险特征可能发生变化,投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

2)标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数所包含的成份证券是证券市场的子集,尽管标的指数成份证券相对证券市场的市值覆盖率较高,但标的指数并不能完全代表整个证券市场,标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(4)跟踪偏差风险

跟踪偏差风险是指基金业绩表现与业绩比较基准表现之间的差异及其不确定性。产生跟踪偏差风险的因素包括但不限于:

1)基金运作过程中发生的费用或成本。包括但不限于管理费、托管费、标的指数使用许可费、基金上市费用、证券交易成本等各项基金费用;

2)股息或利息收入。如指数成份股现金分红的股息收入,基金参与融券所获利息(如有)收入、基金因持有债券而获得的票息收入等;

3)因新股市值配售收益等因素,导致基金收益率超过标的指数收益率,产生正的跟踪偏离度;

4)当标的指数调整成份股构成,或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化,或标的指数变更编制方法时,基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异,而且会产生相应的交易成本,导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大;

5)基金发生申购或赎回。本基金在实际管理过程中由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的成份股票、或在面临投资者赎回时无法将股票及时地转化为现金,这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离度;

6)在指数化投资过程中,基金管理人对指数基金的管理能力,如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度;

7)其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;因缺乏低成本的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

2、与指数增强型策略相关的特定风险

本基金为指数增强型基金,一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪 标的指数,另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。本基金的指数增强策略采用量化模型构建投资组合,因此量化模型的有效性在一定程度上也会影响本基金的表现。面对不断变换的市场环境,量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中;在定量模型的具体设定中,核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性;最后,定量模型存在对历史数据的依赖。因此,在实际运作过程中,可能导致采用量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

3、与股指期货等金融衍生品投资相关的特定风险

(1)基差风险

指股指期货等金融衍生品的合约价格与标的指数价格波动方向及大小不一致而承受的风险。因存在基差风险,在进行股指期货等金融衍生品合约展期的过程中,基金资产可能因基差异常变动而遭受展期风险。

(2)盯市结算风险

股指期货等金融衍生品的合约采取保证金交易方式,对应的保证金账户实行当日无负债结算制度,对资金管理要求较高。如出现极端行情,市场持续向不利方向波动导致保证金不足,在无法及时补足保证金的情形下,保证金账户将被强制平仓,从而导致超出预期的损失。

(3)第三方风险

1)对手方风险

基金管理人运用基金资产投资于股指期货等金融衍生品合约,会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的经纪商,但不能杜绝因所选择的经纪商在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。另外,基金管理人在银行间市场进行交易,也会因为银行间交易对手违约等发生对手方风险。

2)连带风险

为基金资产交易股指期货等金融衍生品进行结算的交易所或登记公司会员单位,或该会员单位下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足,或因其他原因导致相关交易所对该会员下的经纪账户强行平仓时,基金资产可能因相关交易保证金头寸被连带强行平仓而遭受损失。

4、与发起式基金运作方式相关的基金合同提前终止风险

本基金的《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限,存在着基金合同提前终止的风险。

第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、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。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,并报中国证监会备案,决议生效后两日内在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

1、基金合同生效满3年之日,若基金资产规模低于2亿元的;若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,前述终止规定被取消、更改或补充,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行;

2、基金份额持有人大会决定终止的;

3、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;

4、《基金合同》约定的其他情形;

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人或临时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。

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或临时基金管理人、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。

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。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

四、清算费用

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财产中支付。

五、基金财产清算剩余资产的分配

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。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算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。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

第十八部分 基金合同内容摘要

详见附件一:基金合同内容摘要

第十九部分 托管协议内容摘要

详见附件二:托管协议内容摘要

第二十部分 对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者,基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一)基金份额持有人登记服务

基金管理人作为注册登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金管理人配备电脑系统及通讯系统,为基金投资者办理基金账户,基金份额的登记、管理、托管与转托管;基金转换和非交易过户;基金份额持有人名册的管理;权益分配时红利的登记派发;基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

(二)资料递送服务

1、账户资料:投资者开户申请自成功受理之日起的2个交易日后,相关基金账户的开户确认信息可通过销售机构进行查询和打印。

2、交易确认单:投资者自交易指令成功下达之日起的2个交易日后,可通过销售机构查询和打印交易确认单。

3、基金对账单:通常情况,基金管理人自年度结束之日起30个交易日内,向所有基金份额持有人递送年度对账单。如基金份额持有人另有需求,可致电客户服务中心调整对账单的递送频率。

4、其他资料:基金管理人将根据投资者的需求,不定期递送基金管理人介绍和产品宣传推介材料等。

基金管理人提供的资料递送服务原则上以电子形式为主,如基金份额持有人需纸质资料,可致电客户服务中心。对于纸质资料的递送,基金管理人不对资料的邮寄送达做出任何承诺和保证,也不对邮寄过程中所出现的遗漏、泄露而导致的直接或间接损害承担赔偿责任。

(三)客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、交易情况、基金净值等信息的查询。

客户服务中心提供每个交易日9:00~11:30,13:00~17:00人工热线咨询服务。投资人可通过客户服务中心热线电话(400-060-3333)享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单递送、资料修改等专项服务。

非人工服务时间或线路繁忙时,客户服务中心提供电话留言功能,客户服务中心工作人员将根据投资者留言,提供后续服务。

(四)信息定制服务

基金份额持有人可以登录基金管理人网站(www.htcxfund.com),或拨打客户服务中心热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按基金份额持有人的定制提供账户余额、基金信息、产品净值、交易确认、公司活动、理财刊物等。基金管理人可以根据实际业务需要,调整定制信息的条件、方式和内容。

(五)客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心语音留言、呼叫中心人工电话、书信、电子邮件(service@htcxfund.com)等渠道,对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉或提出建议。

第二十一部分 招募说明书的存放与查阅方式

一、招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构的办公场所,并刊登在基金管理人、基金托管人的网站上。

二、招募说明书的查阅方式

投资人可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书,也可按工本费购买本招募说明书的复印件,但应以本基金招募说明书的正本为准。

第二十二部分 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所,在办公时间内可供免费查阅。

(一)中国证监会核准红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金募集的文件

(二)《红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》

(三)《红土创新中证500指数增强型发起式证券投资基金的法律意见书》

(四)中国证监会要求的其他文件

附件一 基金合同内容摘要

第一节 基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

(一)基金管理人简况

名称:红土创新基金管理有限公司

住所:广东省深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人:邵钢

设立日期:2014年6月18日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会,证监许可字[2014]562号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.5亿元人民币

存续期限:持续经营

联系电话:0755-33011866

(二)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(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;

(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;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律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;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(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;

(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;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(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;

(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;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则;

(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。

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:

(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发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(下转A16版)