

(上接A15版)

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

- (10)对基金业务活动,季、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人及在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;
- (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;
- (12)根据需要对基金管理人或其委托的会计师事务所发放并保存基金份额持有人名册;
- (13)按规定制作相关账册并配合基金管理人对其账册与基金托管人核对;
- (14)依据基金管理人的指令完成有关基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (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依法召集基金份额持有人大会;
- (16)按照法律法规及《基金合同》的规定监督基金管理人投资运作;
- (17)根据基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知相关当事人;
- (19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其免责而免除;
- (20)按规定监督基金管理人按法律法规及《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;

- (21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
 - (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。
- 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
- 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人合法授权代表有权代表基金份额持有人出席大会并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

- (一)召开事由
- 1.当出现或需要决定下列事由之一时,应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:
- (1)终止《基金合同》、《基金合同》另有规定的除外;
- (2)更换基金管理人;
- (3)更换基金托管人;
- (4)转换基金运作方式;
- (5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费;
- (6)变更基金类别;
- (7)本基金与其他基金合并;
- (8)变更基金投资目标、范围或策略;
- (9)变更基金份额持有人大会程序;
- (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;
- (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;
- (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;
- (13)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。

- 2.在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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:

- (1)法律法规要求增加的基本费用的收取;
- (2)调整本基金的销售费率、调低赎回费率、销售服务费;
- (3)增加、减少或调整基金类别别及定义,变更调整管理费费率、托管费率之外的收费方式;

- (4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (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;
- (6)基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、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;
- (7)基金管理人履行适当程序后,本基金推出新业务或服务;
- (8)按照法律法规及《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

- 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。
- 2.基金管理人未按规定召集或不能召开时,由基金托管人召集。
- 3.基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并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。

- 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,基金托管人认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并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。

- 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,单独或合计持有基金份额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日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

- 6.基金份额持有人会议的召集人负责选择召开开会时间、地点、方式和权益登记日。
- (3)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
- 1.召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开30日前,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知至少载明以下事项:

- (1)会议召开的时间、地点和审议形式;
- (2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;
- (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;
- (4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于授权人身份、代理权限和代理有效期限等),送达时间和地点;
- (5)会务常设联系人姓名及联系电话;
- (6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (7)召集人需要通知的其他事项。

- 2.采取通讯开会方式并授权委托的,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。

- 3.如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人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,不影响计票和表决结果的效力。

- (四)基金份额持有人大会出席/通讯开会、通讯开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式召开,会议的召开方式应由召集人确定。
- 1.现场开会。由基金份额持有人大会出席/会议以代理投票授权委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均应当出席。基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人拒不派代表参加的,不影响开会和表决效力。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会议:

- (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授权委托书等文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;
- (2)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二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,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的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在权益登记日代表的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二分之一(含二分之一)。

- 2.通讯开会。通讯开会时,基金份额持有人将代表其持有的基金份额的凭证以书面形式或基金份额持有人大会通知载明的其他方式送达指定地点,并至少提前30日将基金份额的凭证以书面形式或基金份额持有人大会通知载明的其他方式进行表决。

- 在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:
- (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;
- (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。

- (3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);若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持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一,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三分之一以上(含三分之一)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。

- (4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人所委托出具的授权人出具表决意见的,同时该授权人持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的授权人出具持有基金份额的凭证及受托人出具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。

- 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、电话等其他非现场方式进行表决,但须符合以下条件:以现场方式结合的方式进行表决,采用网络、电话等其他非现场方式进行表决,或者采用网络、电话等其他非现场方式授权他人代为出席大会并表决。

- (五)议事内容和程序
- 1.议事内容及提案权
- 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、与基金基金合并、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。基金份额持有人大会的提案人发出征集会议的通知后,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。

- 2.议事程序
- (1)现场开会
- 在现场开会方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定会议和公监票人,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二分之一以上(含二分之一)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临时主持人。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效力。

- 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。
- (2)通讯开会
- 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。

- (六)表决
- 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
- 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:
- 1.一般决议,一般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二分之一以上(含二分之一)通过方可生效;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。

- 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三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除《基金合同》另有约定外,转换基金运作方式、更换基金管理人或基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

- 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有公证人现场监督,否则应采取符合会议通知规定的确认投资者身份的方式对表决的有效性进行判断,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。

- 基金份额持有人大会的提案或向同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。
- (七)计票程序
- 1.会议召开
- 基金份额持有人大会由基金管理人、基金托管人召集,基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开前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,但基金管理人和基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开前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。

- (2)如果会议在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人在大会场公布票结果。
- (3)如果会议在基金份额持有人表决后由代理人于开会前将表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投数要求进行重新清点。监票人应当进行结果清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持应当场将会议重新清点结果。
- (4)计票过程应由公证人员予以公证,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。

响计票的效力。

- 2.通讯开会
- 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指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。

(八)生效公告

- 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日内报中国证监会备案并公告。
- 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。
- 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。

- (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,凡是直接涉及法律法规或监管规则的事项,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容不再适用或需要修改,不需召开基金份额持有人大会审议。

- 三、基金收益分配原则、执行方式
- (一)基金收益分配原则
- 1.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.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应类别的基金份额进行再投资;选择红利再投资的,基金份额的红金红利将按照红利发放日的该类基金份额净值折算成相应类别,红利再投资的份额免收申购费。若投资者选择将本基金收益分配收益支付方式选择现金分红:

- 3.基金收益分配后每一基金份额净值不得低于面值,基金收益分配基准日每一类别的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不得低于面值;
- 4.同一类别的每一基金份额享有同等分配权;
- 5.法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。
- 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,可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则,不需召开基金份额持有人大会。

- (二)基金收益分配方案中应载明收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
- (三)收益分配方案的确定、公告与实施
- 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。

- (四)基金收益分配中发生费用
- 基金收益分配时发生的手续费或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利不足以支付相关手续费时,基金管理人有权将基金份额持有人现金红利部分先行垫付给基金份额持有人,按照相应类别的基金份额。红利再投资的费用,依照《业务规则》执行。

- 四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
- (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.标的指数许可使用费;
- 4.本基金份额的基金销售服务费;
- 5.本基金合同生效日至基金相关的信息披露费用;
- 6.本基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;
- 7.基金份额持有人大会费用;
- 8.基金的证券交易费用;
- 9.基金的银行汇划费用;
- 10.基金的开户费用、账户维护费用;

- 11.按照法律法规规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
- 上述基金费用由基金管理人从法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定的从其规定。
- (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0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:

- $H = E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$
- 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,累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付,给基金管理人,在支付时扣减当期应付未付费用,支付日期顺延。

- 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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
- $H = E \times 0.05\% \times \text{当年天数}$
- 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,累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付,给基金管理人,在支付时扣减当期应付未付费用,支付日期顺延。

- 3.指数许可使用费
- 本基金按基金管理人向标的指数提供商所签订的指数使用许可协议中规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。
- 本基金标的的指数许可使用费计算方法如下:

- $H = E \times 0.015\% \times \text{当年天数}$
- H为每日应计提的指数使用费
- E为前一日的基金资产净值
- 本基金成立后的每个季度度费用按基金合同生效日所收取季度费自自然日计提。从基金合同生效后的第二个季度起,标的指数许可使用基金费率按上限为人民币5元/日。指数许可使用费的支付方式为每季度支付一次,自本基金基金合同生效日之后一日起,应于每年1月、4月、7月、10月的第一个工作日内,按照指数使用许可协议中约定的金额支付上一季度的指数许可使用费。除非双方另有约定,以上费用已包含增值税税费。

- 如果指数使用许可协议约定指数许可使用费的计算方法、费率 and 支付方式等发生调整,本基金将按照调整后方法或费率支付指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金费率调整的方法。
- 4.本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,C类基金份额的销售服务费费率为0.10%。

- 销售服务费计提的计算公式如下:
- $H = E \times 0.10\% \times \text{当年天数}$
- H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
- E为C类基金份额前一日基金资产净值
- C类基金份额销售费每日计提,累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

- 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,由基金托管人从基金财产中支付。
- 五、基金财产的投资方向和投资限制
- (一)投资范围
- 本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,为更好实现投资目标,还可以投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的政策性金融债、国债、债券回购以及法律法规和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本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。
- 基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;其中标的指数的成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的90%;每个交易日日终应当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保证金、存出保证金、应收申购款等。

- 当法律法规的相关规定变更时,基金管理人可在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。
- 2.本基金各类品种的投资比例、投资限制为:
- (1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的90%;

- (2)本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算保证金、存出保证金及应收申购款等;
- (3)本基金在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的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
- (4)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

- (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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- (6)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其他投资限制保持一致;
- (7)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)、(5)、(6)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人无法控制的因素导致基金投资组合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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定的规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

- 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。
- 二、禁止行为
- 为保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)向其他基金管理人、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、行政法规及中国证监会禁止的其他活动。

- 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,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的利益优先原则,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。重大关联交易必须经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、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
- 六、基金资产净值的计算方法及公告方式
- 1.基金资产净值按照以下方法计算:基金资产净值除以当日基金份额的余额数量,精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情况的净值预提应急调整机制。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各类基金份额的基金份额净值,并按规定公告。
- 基金管理人应当每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值,但基金管理人根据法律法规或基金合同的约定暂停估值的情形除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额的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,由基金托管人按照约定对外公布。

- 七、基金合同解除和终止的事由、程序及基金财产清算方式
- (一)《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.基金份额持有人大会决定终止;
- 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;

- (二)《基金合同》生效之日起满60个工作日出现基金份额持有人人数不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当终止基金合同,不需要召开基金份额持有人大会;
- (三)《基金合同》约定的其他情形;终止事由出现后,基金管理人应当履行通知和公告义务。
- (四)基金合同终止后的财产清算
- 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组织清算事宜。

- 2.基金财产清算小组组成:基金财产清算小组由基金管理人、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请必要的工作人员。
- 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)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;
- (5)将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (6)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,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。
- (三)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剩余财产中支付。

- (四)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。

- (五)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清算小组负责人签署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。

- (六)基金财产清算账册及文件的保存
- 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
- 八、争议解决方式
- 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,应提交上海仲裁委员会仲裁,仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人具有约束力,除非仲裁裁决另有规定,仲裁费由败诉方承担。

- 争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。
- 《基金合同》受中国法律管辖。
- 九、基金合同存放地点及投资人取得基金合同的方式
- 《基金合同》文本一式六份,除上列有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持一份,每份具有同等法律效力。

- 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。

- 一、托管协议当事人
- (一)基金管理人名称:华安基金管理有限公司住所: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层法定代表人:朱圣华

- 设立日期:1998年6月4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;中国证监会证监基字【1998】20号
- 组织形式:有限责任公司注册资本:15.1亿元存续期限:持续经营

- 联系电话:(021)39869999
- (二)基金托管人名称:徽商银行股份有限公司住所:安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座办公地址:安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座邮政编码:230001

- 法定代表人:吴学民
- 成立日期:1997年4月4日基金托管业务批准文号:证监许可【2014】63号

- 组织形式:股份有限公司注册号码:1,215,480,121.1万元人民币
- 存续期限:持续经营
- 一、基金托管人对基金托管人业务监督和核查

- (一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联交易等,进行监督核查。
- 1.本基金的投资范围为:

- 本基金主要投资于标的指数的成份券及备选成份券,为更好实现投资目标,还可以投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的政策性金融债、国债、债券回购以及法律法规和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本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

- 基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的90%;其中标的指数的成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%;每个交易日日终应当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保证金、存出保证金、应收申购款等。
- 当法律法规的相关规定变更时,基金管理人可在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

- 2.本基金各类品种的投资比例、投资限制为:
- (1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的90%;

- (2)本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算保证金、存出保证金及应收申购款等;
- (3)本基金在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的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
- (4)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

- (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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- (6)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其他投资限制保持一致;
- (7)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)、(5)、(6)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致基金投资组合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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定的规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

- 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制,但须提前公告,不须经基金份额持有人大会审议。
- 三、基金财产不得用于以下投资或者活动:
- (1)承销证券;
- (2)基金财产不得用于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、行政法规及中国证监会禁止的其他活动。

- 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,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的利益优先原则,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。重大关联交易必须经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、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或按变更后规定执行,但须提前公告,不须经基金份额持有人大会审议。
- (二)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人选择银行进行监督。基金托管人监督基金银行存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,确定合格存款银行的所有存款银行的名册,并及时提供基金托管人,基金托管人应对以上合格存款银行的所有存款银行进行监督,并符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款,基金托管人有权拒绝执行,并通知基金管理人。

- 本基金基金银行存款应符合如下规定:
- 1.基金管理人负责对基金银行存款的评估与选择,建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度,切实防范有关风险。基金管理人负责对银行定期存款业务的监督和检查,审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等文件,切实履行监督职责。

- 2.基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等是否与存款银行选择方式的风险,因选择存款银行不当造成基金财产损失的,由基金管理人承担责任。
- 3.基金管理人负责控制流动性风险,并承担因控制不力而造成的风险。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取未能及时兑付的风险。基金投资银行存款不能确保资金正正常流转业务的风险。因全部提前支取或部分提前支取而涉及的资金损失影响估值等或受到基金流动性风险的影响。

- 4.基金管理人不得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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- 5.基金管理人应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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同约定的规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

- 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。
- 二、禁止行为
- 为保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;