B080 信息披露 Disclosure

(上接B079版)

- 因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 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;
- 本基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则(包括但不限于申购赎回清算的开放、开放时间的调整等);
- 基金推出新业务或服务;
- 本基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置,对基金份额类别划分及规则进行调整;
- 按照指数编制机构的要求,根据指数使用许可协议的约定变更标的指数许可使用费率标准和计算方法;
- 在不违反法律法规的情况下,本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回;
- 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。

(二)会议召集人及召集方式

- 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。
- 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。
- 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,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,并书面告知基金管理人。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,并书面告知基金管理人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合,不得阻碍、干扰。
- 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。
- 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
 - 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:
 - 会议召集的时间、地点和审议事项;
 - 会议审议的事项、议事程序和表决方式;
 - 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;
 - 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;
 - 会务常设联系人姓名及联系电话;
 - 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
 - 召集人需要通知的其他事项。
 - 采取通讯开会方式并先行表决的情况下,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。

- 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,则应另行书面通知基金管理人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按规定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。

(四)基金份额持有人大会的形式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或由代理投票授权委托书代表出席,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会议:

- 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书符合法律法规、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;
- 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有效,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)。若召集人在权益登记日前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,召集人可以在不公告的情况下召集基金份额持有人大会召开时间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会议在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

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。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。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

- 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;
- 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或授权他人代表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书符合法律法规、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.在法律法规和监管机构允许的情况下,本基金的基金份额持有人可采用书面、网络、电话、短信或其他电子方式授权他人出席基金份额持有人大会,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4.在会议召开方式上,本基金可采用现场开会方式或通讯方式与非现场开会相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序须符合法律法规和基金合同约定的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他电子方式进行表决,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

(五)议事内容与程序

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、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。

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。

2.议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程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。大会由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会议的主持人。基金管理人或基金托管人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。

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审议事项,应当遵循以下原则和表决程序: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二分之一以上(含二分之一)通过方可做出;除法律法规

规另有规定或本合同另有约定外,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、本基金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。

基金份额持有人大会的各项提案或同一提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

在上述规则的前提下,具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

1.7.计票

(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,但是基金管理人未授权召集人,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。

(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会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金托管人有未授权人员对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。

(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,不影响计票和表决效力。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起10日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证文书、公证机关、公证证号等一同公告。

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)本基金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,基金管理人可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。

三、基金的投资

(一)基金的投资范围

1. 每一基金份额享有同等分配权;

2. 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。在收益分配日,基金管理人将对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算,计算方法参见招募说明书;

4. 本基金以原则收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金资产的特性和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使基金份额净值低于面值;

5. 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

6. 法律法规或监管机构另有规定的,从其执行。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下,基金管理人可在法律法规允许的前提下酌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,但应于变更实施日前在指定媒介公告。

(二)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

本基金收益分配方式由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(四)基金收益分配中产生的费用

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。

四、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. 基金管理人或基金托管人履行与基金运作有关的费用;

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。基金财产投资的相关税费,由基金份额持有人承担,基金管理人或其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金的投资

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

(二)投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股。

为了更好地实现基金的投资目标,本基金可适当少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市

的股票),债券(包括国内依法发行和上市交易的公司债券、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券),货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债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

的相关规定)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;

本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的

交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

六、基金的投资策略

(一)资产配置

本基金根据对宏观经济、政策、市场、估值、流动性等因素的综合分析,在基金合同约定的范围内,合理配置股票、债券、货币市场工具、

股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、

同业存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、

同业存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、同业