（上接A13版）

传真:010-66223314
客户服务电话:北京010-96169 天津022-96269 上海021-53599688
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn
13)深圳发展银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克.纽曼
联系人:周勤
电话:0755-82080714
传真:0755-82080714
客户服务电话:95501
公司网站: www.sdb.com.cn
14)华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:翟鸿祥@客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn
15)平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路1099号
法定代表人:孙建一
联系人:霍兆龙
电话:0755-25859591
传真:0755-25879453
客户服务热线:400-669-9999
公司网站: www.pingan.com
16)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号@法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
电话:021-63586210
传真:021-63586215
客户服务热线:96528,上海地区:962528
公司网站:www.nbcb.com.cn
17)中信证券股份有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
电话:010-84864818-63266
传真:010-84865560
联系人:陈忠
客户服务电话:95558
网址:www.ecitic.com
18)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:010-65183888
传真:010-65182261
联系人:权唐
客户服务电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com
19)中信万通证券有限责任公司
注册(办公)地址:青岛市市南区东海西路28号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022511
客户咨询电话:0532-96577
联系人:丁邵燕
网址:www.zxwt.com.cn
20)第一创业证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B座25层
法定代表人:刘学民
电话:0755-25832494
传真:0755-25831718
联系人:王立洲
客户服务电话:0755-25832523
网址:www.firstcapital.com.cn
21)平安证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区八卦岭八卦3路平安大厦3楼
法定代表人:杨宇翔
电话:0755-22627802
传真:0755-82433794
联系人:袁月
客户服务电话:95511
网址:www.pa18.com
22)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
客户服务电话:400-888-8123
网址:www.xyzq.com.cn
23)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-213
传真:021-62152814
联系人:芮敏祺
客户服务电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com
24)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:020- 87555305
联系人:肖中梅
网址:http://www.gf.com.cn
25)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼
法定代表人:何如
电话: 0755-82130833
传真: 0755-82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
26)中银国际证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:平岳
客户服务电话:400-620-8888
联系人:张静
网址:www.bocichina.com
27)光大证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:400-888-8788 10108998
公司网站:www.ebscn.cn
28)联合证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马昭明
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
联系人:盛宗凌
客户服务电话:400-8888-555 0755-25125666
网址:www.lhzq.com
29)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦10层
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
联系人:李笑鸣
客户服务咨询电话:021-962503 400-888-8001
网址:www.htsec.com
30)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
联系人:张萍
客户服务热线:400-888-8228
公司网站:www.jyzq.com.cn
31)申银万国证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54038844
联系人:曹晔
客户服务电话:021-962505
网址: www.sw2000.com.cn
32)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
电话:022-28451861
传真:022-28451616
联系人:王兆权
客户服务电话:022-28455588
公司网址:http://www.ewww.com.cn
33)东海证券有限责任公司
注册(办公)地址:江苏省常州延陵西路59号常信大厦18楼
法定代表人:朱科敏
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
联系人:李涛
客户服务热线:0519-88166222 0379-64902266 021-52574550
免费服务热线:400-888-8588(免长途费)
网址:http://www.longone.com.cn
34)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
客户服务电话:400-888-8128
电话:021-68761616
传真:021-68767981
网址:www.tebon.com.cn
35)东吴证券有限责任公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
办公地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务热线:0512-33396288
网址:http://www.dwzq.com.cn
36)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4028号荣超经贸中心26层11、12
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:王少华
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
37)山西证券股份有限公司
办公(注册)地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
联系人:张治国
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn
38)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市黄浦区九江路111号
法定代表人:蒋元真
电话:021-62470157
传真:021-62470244
客服电话:021-962518
联系人:谢秀峰
公司网址:http://www.962518.com
39)安信证券股份有限公司
办公(注册)地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82558305
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-800-1001
网址:http://www.essences.com.cn
40)信泰证券有限责任公司
注册地址:南京市长江路88号
办公地址:江苏省南京市长江路88号国信大厦18、19楼
法定代表人: 钱凯法
电话:025-84784782
传真:025-84784830
联系人:万鸣/舒萌菲
客户服务电话:400-888-8918
网址:www.thope.com
41)国元证券股份有限公司
注册(办公)地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
电话:0551-2207938
传真:0551-2207935
联系人:祝丽萍
客户服务电话:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn
42)长城证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
客户服务电话:400-666-6888
联系人:高峰
公司网站:http://www.cc168.com.cn
43)恒泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:刘汝军
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
联系人:常向东
客户服务电话:0471-4961259
网址:www.cnht.com.cn
44)万联证券有限责任公司
注册(办公)地址:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人:李舫金
电话:020-37865070
传真:020-37865008
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
45)齐鲁证券有限公司
注册(办公)地址:山东济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
联系人:傅咏梅
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
46)江海证券有限公司
注册(办公)地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:徐世旺
联系电话:0451-82336863
联系传真:0451-82287211
客服电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
47)爱建证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市南京西路758号24楼
法定代表人:张建华
电话:021-32229888
联系人:颜奕斌
业务联系电话:021-32229888-3113
网址:www.ajzq.com
48)华宝证券经纪有限责任公司
注册(办公)地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人:陈林
电话:021-50122107
联系人:楼斯佳
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com
49)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87841160
传真:0591-87841150
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
网址:www.gfhfzq.com.cn
50)西南证券股份有限公司
注册(办公)地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22楼
法定代表人:王珠林
电话:023-63786777
传真:023-63786312
联系人:杨卓颖
网址:www.swsc.com.cn
51)财通证券有限责任公司
注册(办公)地址:杭州市解放路111号
法定代表人:沈继宁
客户服务电话:0571-96336
传真:0571-87925129
联系人:乔骏
网址:www.ctsec.com
52)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦17楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文@电话:0592-5161642
传真: 0592-5161140
客服电话:0592-5163588
网址:www.xmzq.cn
53)东北证券股份有限公司
注册(办公)地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:潘锴
开放式基金咨询电话:0431-85096709
客户服务电话:400-600-0686 0431-85096733
网址: www.nesc.cn
54)中国银河证券股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:胡长生
客户服务电话:400-888-8888
电话:010-66568047
传真:010-66568532
联系人:李洋
网址:www.chinastock.com.cn
55)华泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-84457777
传真:025-84579879
客户服务电话: 025-84579897
联系人:程高峰
网址:www.htsc.com.cn
56)湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海市浦东银城东路139号华能联合大厦5层
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518
传真:021-68865938
联系人:钟康莺
开放式基金咨询电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com
57)南京证券有限责任公司
注册(办公)地址:江苏省南京市大钟亭8号
法人代表:张华东
客户服务电话:400-828-5888
传真:025-83364032
联系人:胥春阳
公司网站: www.njzq.com.cn
58)中信金通证券有限责任公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:0571-85776115@客户服务电话:96598
联系人:俞会亮
网址:www.bigsun.com.cn
59)招商证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82960141
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,0755-26951111
网址:www.newone.com.cn
60)广州证券有限责任公司
注册(办公)地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼
法定代表人:吴志明
电话:020-87322668
联系人:樊刚正
客户服务电话:020-961303
网址:www.gzs.com.cn
网址:http://www.dtsbc.com.cn/
61)大同证券经纪有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
办公地址:山西省太原市青年路8号
法定代表人:董祥
电话:0351-5680800-8208
联系人:苏妮
客户服务电话:0351-4167056
62)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸11楼
法定代表人:石保上
客户服务电话:967218 、400-813-9666
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
联系人:程月艳
网址:www.ccnew.com
63)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
联系电话:010-66045566
客服电话:010-66045678
传真:010-66045500
天相投顾:http://www.txsec.com
天相基金网:http://www.txjijin.com
64)长江证券股份有限公司@注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:上海市世纪大道1589号长泰国际金融中心21F
法定代表人:胡运钊
电话:021-68751929
传真:021-51062920
客户服务热线:400-8888-999 027-85808318
联系人:李良
网址:www.95579.com
65)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心15层
法定代表人:刘弘
客户电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com

(2)场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
联系人:任瑞新
办公地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话:(010) 58598835
传真:(010) 58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市众一律师事务所
住所:北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室
办公地址:北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室
负责人:常建
电话:010-64096089
传真:010-64096188
联系人:云大慧
经办律师:云大慧、胡广志

(四)会计师事务所及经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东3办公楼)16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:张小东、王珊珊
电话:010-58153322;010-58152145
传真:010-85188298
联系人:王珊珊

六、基金的募集

(一)基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定,经中国证监会证监许可[2009]793号文核准募集。

(二)基金类型

股票型基金

(三)基金的运作方式

上市契约型开放式

(四)上市交易所

深圳证券交易所

(五)基金存续期间

不定期

(六)基金份额初始面值

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元。

(七)募集方式

通过基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点,具体名单见基金份额发售公告)公开发售。

(八)募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金自2009年9月4日至2009年9月30日进行发售。如果在此期间届满时未达到本招募说明书第七章第(一)条规定的基金备案条件,基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

(八)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及其他投资人。

(九)募集场所

本基金的场外认购通过基金管理人直销机构、代销机构办理基金销售业务的营业场所办理或按基金管理人直销机构、代销机构提供的其他方式办理。销售机构名单和联系方式见本招募说明书“五、相关服务机构”。

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位进行。本基金认购期结束前获得基金代销业务资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金代销业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的交易。

基金管理人直销机构、代销机构办理基金认购业务的地区、网点的具体情况和联系方法,请参见本基金基金份额发售公告以及当地销售机构的公告。

基金管理人可以根据情况变更或增减基金代销机构,并另行公告。

(十)募集规模

本基金募集份额总额不少于2亿份,募集金额不少于2亿元人民币。

本基金不设募集上限。

(十一)投资人对基金份额的认购

1.认购时间安排:

本基金认购时间:2009年9月4日至2009年9月30日。场内认购具体开放时间为深圳证券交易所交易日交易时间,场外认购具体开放时间以各销售机构的规定为准。

各个销售机构在本基金发售募集期内对于个人投资者或机构投资者的具体业务办理时间可能不同,若本招募说明书或份额发售公告没有明确规定,则由各销售机构自行决定每天的业务办理时间。

2.认购原则:

(1)基金场外认购采用金额认购方式,场内认购采用份额认购方式;

(2)投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款;

(3)投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销,认购费率按每笔认购申请单独计算;

(4)认购期间单个投资人的累计认购规模没有上限限制;

(5)销售网点(包括直销机构和代销网点)受理认购申请并不表示对该申请已经成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请。

3.认购限额:

本基金场内认购采用份额认购的方式。场内认购时,投资者以份额申请,最低认购份额为1,000份,超过1,000份的应为1,000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。

本基金场外认购采用金额认购的方式。每个基金账户首笔认购的最低金额为人民币1,000元,每笔追加认购的最低金额为1,000元。直销机构或各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以其业务规定为准。

4.投资人认购应提交的文件和办理的手续:

投资者办理场内认购时,需具有深圳证券账户。已有深圳证券账户的投资者可直接认购上市开放式基金。尚无深圳证券账户的投资者可通过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构开立账户。

投资者办理场外认购时,需具有开放式基金账户。其中:已通过场外销售机构办理过开放式基金账户注册或注册确认手续的投资者,可直接办理本基金场外认购业务;已有深圳证券账户的投资者,可通过场外销售机构以其深圳证券账户申请注册开放式基金账户;尚无深圳证券账户的投资者,可直接申请账户开户,中国证券登记结算有限责任公司将为其配发深圳基金账户,同时将该账户注册为开放式基金账户。

投资人认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

(十二)认购费用

投资人认购需缴纳认购费用。本基金认购费率如下表所示:

	认购金额(M,含认购费)	费率
场外认购费率	M<50万元	1.0%
	50万元≤M<200万元	0.6%
	200万元≤M<500万元	0.3%
	M≥500万元	按笔收取,1000元/笔
场内认购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外认购费率设定投资者的场内认购费率。	

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。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用,不从基金财产中列支。

(十三)认购的计算

1.场内认购

场内认购为份额认购,认购份额为整数。

本基金场内认购认购金额以及利息折算的份额计算公式如下:

认购金额=挂牌价格×(1+认购费率)×认购份额
认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率
净认购金额=挂牌价格×认购份额
利息折算的份额=利息/挂牌价格
其中挂牌价格为人民币1.00元。

2.场外认购

场外认购为金额认购,认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

本基金场外认购认购份额的计算公式如下:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)
(注:认购金额在500万元(含)以上的,适用固定金额的认购费,即净认购金额=认购金额-固定认购费金额)
认购费用=认购金额-净认购金额
认购份额=(净认购金额+利息)/认购价格
其中认购价格为1.00元。

(十五)认购的确认

对于T日交易时间内受理的认购申请,注册登记机构将在T+1日就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资人的认购申请,认购申请的成功确认应以注册登记机构在本基金认购结束后的登记确认结果为准。投资者可以在本基金成立后到各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。

(十六)募集资金利息的处理方式

认购款项在认购期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,由利息所转的份额以基金注册登记机构的记录为准。其中,场内认购利息折算的份额以截位法保留到个位数,小数点以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有;场外认购利息份额的折算以截位法保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

(十七)募集资金的管理

认购期内,投资者的认购款项只能存入专用账户,不得动用。认购期结束后,由注册登记机构计算投资者认购应获得的基金份额,基金管理人应在10日内聘请会计师事务所进行认购款项的验资。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件

1.本基金自基金份额发售之日起3个月内,在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,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期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,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起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。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。

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。

3.本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(二)基金募集失败

1.基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。

2.如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5,000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

八、基金份额的上市交易、申购、赎回与转换

本基金为上市契约型开放式基金,投资者可以通过上市交易、场外申购赎回、场内申购赎回三种方式,实现基金份额的日常交易。

(一)基金份额的上市交易

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额上市交易。

1.上市交易的地点

深圳证券交易所。

2.上市交易的时间

本基金拟在合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

基金上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内后,方可上市交易。

3.上市交易的规则

(1)本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;

(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;

(3)本基金买入申报数量为100份或其整数倍;

(4)本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

(5)本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定。

4.上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

5.上市交易的行情揭示

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基金前一交易日的基金份额净值。

6.上市交易的停复牌 、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

7.上市交易的其他业务规则按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

8.相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(二)申购和赎回场所

投资者办理场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回业务。

投资者办理场外申购和赎回业务的场所为基金管理人和场外代销机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司(深圳)开放式基金账户办理场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单参见本招募说明书“五、相关服务机构”部分相关内容及基金份额发售公告或其他公告。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。

(三)基金销售对象

个人投资者、机构投资者和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者。

(四)申购和赎回的开放日及时间

1.开放日及业务办理时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的申购赎回开放日。场内业务办理时间为深圳证券交易所交易日交易时间,场外业务办理时间以各销售机构的规定为准。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

2.申购与赎回的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过90天开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过90天开始办理赎回,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》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

(五)申购与赎回的原则

1.“未知价”原则,即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

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;

3.当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销,在当日的开放时间结束后不得撤销;

4.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的相关业务规则;

5.基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但应在新的原则实施前按照《信息披露管理办法》有关规定予以公告。

(六)申购与赎回的程序

1.申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金时,须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

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。

2.申购与赎回申请的确认

T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)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。

3.申购与赎回申请的款项支付

基金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。若申购不成功或无效,申购款项将退回投资者银行账户。基金份额持有人赎回申请确认后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内将赎回款项划至基金份额持有人银行账户。

4.申购与赎回的登记结算

(1)投资者T日申购基金成功后,注册登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记结算手续,投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

(2)投资者T日赎回基金成功后,注册登记机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的登记结算手续。

(3)基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述登记结算办理时间进行调整,并于开始实施前按照《信息披露管理办法》有关规定予以公告。

(七)申购和赎回的数额限制

1.投资者通过场内或场外办理申购时,每笔申购金额不得低于1,000元。

直销中心或各代销机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的,以其业务规定为准。

2.基金份额持有人在销售机构赎回时,单笔赎回申请不得低于500份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)单个交易账户保留的基金份额余额不足500份的,余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3.投资人将场外申购的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时,不受最低申购金额的限制。

4.本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

5.基金管理人可根据市场情况,依据法律法规合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人进行前述调整须按照《信息披露管理办法》有关规定至少在一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

(八) 申购份额与赎回金额的计算方式

1.本基金申购份额的计算:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购金额在500万元以上的适用固定金额的申购费,即净申购金额=申购金额-固定申购费金额。
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

2.本基金赎回金额的计算:

采用“份额赎回”方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算,计算公式:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额—赎回费用

3.本基金基金份额净值的计算:

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。本基金基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

4.申购份额、余额的处理方式:

场内申购时,申购份额的计算采用截位法保留至整数位,不足1份额对应的申购资金返还至投资者资金账户。

场外申购时, 申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后, 以当日基金份额净值为基准计算,申购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

5.赎回金额的处理方式:

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后的余额, 赎回金额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

(九) 申购和赎回的费用及其用途

1.申购费率

	申购金额(M,含申购费)	申购费率
场外、场内申购费	M<50万元	1.2%
	50万元≤M<200万元	0.8%
	200万元≤M<500万元	0.4%
	M≥500万元	按笔收取,1000元/笔

2.赎回费率

本基金的场外赎回费率不高于0.5%,随基金份额持有期限的增加而递减;本基金的场内赎回费率为固定赎回费率0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。

	持有期限(Y)	费率
场外赎回费	Y<1年	0.5%
	1年≤Y<2年	0.2%
	Y≥2年	0%
场内赎回费	本基金场内赎回费为固定值0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

注:1年指365天。

3.本基金申购费在投资者申购基金份额时收取。本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取。

4.本基金的申购费用由投资人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用,不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费和其他手续费。

5.基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或计算方式。费率或计算方式如发生变更,基金管理人应在调整实施前按照《信息披露管理办法》有关规定至少在一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

6.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,针对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,经相关销售机构同意,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、赎回费率。

(十) 基金份额的注册登记

1.本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购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。

2.登记在注册登记系统中的基金份额可通过基金销售机构申请赎回,但不可卖出。

3.登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易,也可直接申请赎回。

(十一) 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基金投资者的申购申请:

1.因不可抗力导致基金无法正常运作;

2.证券交易所交易时间依法决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;

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,或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购;

5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资者。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。

(十二) 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基金投资者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.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。

3.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应依法及时报中国证监会备案,已接受的赎回申请,基金管理人应按时足额支付;如暂时不能足额支付, 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,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过20个工作日,并在指定媒体上公告。投资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。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予以公告。

(十三) 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)超过前一开放日的基金总份额的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顺延赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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日基金总份额的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;基金投资者未能赎回部分,投资者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,当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一个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。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择,投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3.巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时, 基金管理人应在2日内通过中国证监会指定媒体或代销机构的网点刊登公告,并在公开披露日向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,并通过邮寄、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,并说明有关处理方法。

连续2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,并应当在指定媒体进行公告。

(十四) 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,基金管理人应依法及时向中国证监会备案,并依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放申购或赎回日,在指定媒体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日但少于2周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应在重新开放申购或赎回日前依法及时在指定媒体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。

4.如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。当连续暂停时间超过2个月的,基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依法及时在指定媒体上连续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。

(十五) 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,并提前告知基金托管人与相关机构。

(十六)基金转托管

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

1.系统内转托管

(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(席位)之间进行转托管的行为。

(2)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,销售机构(网点)之间不能通存通兑的,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3)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的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

2.跨系统转托管

(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。

(2)本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

(十七)基金的非交易过户、冻结与解冻

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则,受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务,并收取一定的手续费用。

(十八)定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下,本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务,具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时的公告为准。

(十九) 其他特殊交易

在相关法律法规有明确规定的条件下,基金管理人还可办理除上述业务以外的其他特殊交易业务。

九、基金的投资

(一)投资目标

本基金运用指数化投资方法,通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段,追求跟踪误差最小化,力争控制本基金的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0.35%,年跟踪误差不超过4%。

(二)投资理念

本基金认为,中国经济持续稳定增长的发展态势为中国证券市场的发展奠定了坚实的基础。本基金以复制、跟踪沪深300指数为原则,进行被动式指数化长期投资,从而以较低的成本获得该指数所代表的中国证券市场的平均收益率,为投资者提供一个投资沪深300指数的有效投资工具,以分享中国经济增长带来的中长期收益。

(三)投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%,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%。在保证流动性的前提下,如果法律法规允许,在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(如股票指数期货等金融产品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(四)标的指数

本基金以沪深300指数为标的指数。

如果沪深300 指数被停止编制及发布,或沪深300 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沪深300 指数不宜继续作为标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,变更本基金的标的指数;并依据市场代表性、流动性、与原指数相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更标的指数,基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上予以公告。

(五)投资策略

本基金原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪沪深300指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

如未来法律法规或中国证监会允许, 本基金还将投资于股票指数期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品,以使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的,需将有关投资方案和基金托管人协商一致,并在报中国证监会备案后公告。

1.资产配置策略

本基金管理人主要按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%,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%。在保证流动性的前提下,如果法律法规允许,在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。

2.股票投资组合构建

(1)组合构建原则

本基金原则上通过完全复制指数的方法,根据沪深300指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

(2)组合构建方法

本基金原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪沪深300指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

但因特殊情况(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(如买入非成份股等)进行适当的替代。

(3)组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据沪深300指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以保证基金净值增长率与沪深300指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

①定期调整

根据沪深300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。

②临时调整

A.当上市公司发生增发、配股等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重变化及时调整股票投资组合;

B.根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪沪深300指数;

C.根据法律、法规的规定,成份股在沪深300指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

(4)投资绩效评估

本基金日均跟踪偏离度的绝对值力争不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施将跟踪误差控制在限定的范围之内。

(六)投资决策依据和决策流程

1.决策依据

(1)国家有关法律、法规、基金合同和标的指数编制、调整等相关规定,以及基金管理人事先制定的指数复制和跟踪策略,并以维护基金份额持有人利益为最高准则;

(2)国家宏观经济运行态势和证券市场走势。

2.决策程序

(1)投资管理部金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析,依此提出研究分析报告;

(2)A股投资决策委员会依据投资管理部提供的研究报告,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,进行基金投资管理的日常决策;

(3)根据标的指数,结合研究报告,基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合,在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低交易成本、控制投资风险;

(4)交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(5)投资管理部绩效与风险评估小组根据市场变化定期和不定期对投资组合进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制;

(6)基金经理根据跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、投资管理部和监察稽核部提供的绩效评估报告以及对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(七)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

由于本基金的投资标的为沪深300指数,且本基金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5%,因此,本基金将业绩比较基准定为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

如果今后法律法规发生变化,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,本基金可以在基金管理人和基金托管人协商一致,履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

(八)风险收益特征

本基金为复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

(九)禁止行为和投资限制

1.依照《基金法》,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)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,但是法律法规或监管机关另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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;

(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;

(8)依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门修改或取消上述禁止性规定, 本基金管理人在履行适当程序后可相应调整投资禁止行为的规定,不受上述规定的限制。

2.投资组合比例限制

(1)基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(2)本基金不得违反基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定;

(3)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。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。

如果法律法规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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

(十)基金的融资、融券

本基金可以按照国家相关法律法规规定进行融资、融券。

(十一)基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

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,保护基金份额持有人的利益;

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;

3.有利于基金财产的安全与增值;

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当利益。

十、基金的财产

(一)基金资产总值

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、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

(二)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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)基金财产的保管与处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。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入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。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。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

十一、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正常工作日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日。

(二)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、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,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)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,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;

(3) 交易所上市未实行净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,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(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,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;

(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)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估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3.全国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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

4.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。

5.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。

6.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。

(三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

(四)估值程序

1.基金份额净值是按照每个开放日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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。基金管理人每个开放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。

(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3位以内(含第3位)发生差错时,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.差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人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”承担赔偿责任。

上述差错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;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

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。

2.差错处理原则

(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,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;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。

(2)差错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,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(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。

(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。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、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出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

3.差错处理程序

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:

(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;

(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;

(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正和赔偿损失;

(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。

4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(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)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5)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。

(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.因不可抗力或其它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;

3.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开放日交易结束后计算当日的基金资产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)特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按上述“(二)估值方法”中的第5项方法进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。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。

十二、基金的收益与分配

(一)基金收益的构成

1.买卖证券差价;

2.基金投资所得红利、股息、债券利息;

3.银行存款利息;

4.已实现的其他合法收入;

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(二)基金期末可供分配利润

基金期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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, 基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额;

3.本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的30%;

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

5.登记在注册登记系统的基金份额,其基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式为现金分红,投资者不能选择其他的分红方式,具体收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;

6.基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;

7.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;

(下转A16版)