（上接A27版）

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、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，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：

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，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

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，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。金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.上市公司经营风险。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、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，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5.购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（二）本基金特有的风险

1、创业板指数波动的风险

创业板指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动。由于本基金主要投资于创业板ETF，基金收益水平会发生变化，产生风险。

2、创业板市场的特殊风险

本基金的主要投资标的是创业板ETF、创业板指数成份股及备选成份股，面临创业板市场的特殊风险，包括但不限于：

①规则差异风险

创业板市场发行、上市等业务规则与现有的主板、中小企业板市场的相关业务规则存在一定差别。

②上市公司退市风险

创业板市场上市公司退市制度设计较主板市场更为严格，与主板市场相比，可能导致创业板市场上市公司退市的情形更多，退市速度可能更快，退市以后可能面临股票无法交易的情况，购买该公司股票的投资者将可能面临本金全部损失的风险。

③上市公司经营风险

与主板市场上市公司相比，创业板市场上市公司一般处于发展初期，经营历史较短，规模较小，经营稳定性相对较低，抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱。此外，创业板市场上市公司发展潜力虽然可能巨大，但新技术的先进性与可靠性、新模式的适用面与成熟度、新行业的市场容量与成长空间等都具有较大不确定性，投资者对创业板市场上市公司高成长的预期并不一定会实现，风险较主板大。

④股价大幅波动风险？

以下原因可能导致创业板市场上市公司股价发生大幅波动：

1）公司经营历史较短，规模较小，抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱，股价可能会由于公司业绩的变动而大幅波动；

2）公司流通股本较少，盲目炒作会加大股价波动，也相对容易被操纵；

3）公司业绩可能不稳定，传统的估值判断方法可能不尽适用，投资者的价值判断可能存在较大差异。

⑤技术失败风险

创业板市场上市公司高科技转化为现实的产品或劳务具有不确定性，相关产品和技术更新换代较快，存在出现技术失败而造成损失的风险。

3、指数编制机构发布数据错误风险

如果指数编制机构发布的成份股数据出现错误，创业板ETF的资产净值可能受到不利影响。由于本基金主要投资于创业板ETF，本基金资产净值也将受到不利影响。

4、基金收益率与业绩基准收益率偏离的风险，主要影响因素包括：

①创业板ETF对创业板指数的跟踪误差：本基金主要通过投资于创业板ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，创业板ETF对创业板指数的跟踪误差会影响本基金对业绩基准的跟踪误差；

②本基金发生申购赎回、管理费和托管费收取等其他导致基金跟踪误差的情形。

5、由于本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与创业板ETF不同，因此本基金具有与创业板ETF不同的风险收益特征及净值增长率。

6、本基金属于联接基金，主要投资于目标ETF，因此目标ETF面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

7、在本基金目标ETF创业板交易型开放式指数证券投资基金未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。

（三）流动性风险

基金的流动性风险主要表现在三个方面：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于市场流动性相对不足而无法按预期的价格将创业板ETF、股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金管理人的现金支付出现困难，被迫在不适当的价格大量抛售创业板ETF、股票或债券；三是创业板ETF暂停赎回或暂停在二级市场交易，导致基金管理人出现现金支付困难，基金管理人因此暂停接受投资者的赎回申请。以上情形均可能给本基金带来不利影响。

（四）管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2、基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

（五）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金代销机构等机构无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

十九、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、按照法律法规或《基金合同》的规定，对《基金合同》的变更应当召开基金份额持有人大会的，《基金合同》变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准。

2、上述对《基金合同》的变更事项自中国证监会核准之日起生效，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

3、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，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：

①调低基金管理费、基金托管费；

②在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

③因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

④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变化；

⑤根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

①遵守《基金合同》；

②缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

③在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

④不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

⑤返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

⑥）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

⑦）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。

（四）基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人或其合法授权代表有权在授权范围内代表基金份额持有人行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标ETF份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会。

2、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

①终止《基金合同》；

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提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

⑥变更基金类别；

⑦本基金与其他基金的合并；

⑧）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

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）基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会；

⑫）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；

⑬）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

⑭）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。

3、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调低基金管理费、基金托管费；

②法律法规要求增加的基金费用的收取；

③在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

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变化；

⑥经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

⑦经中国证监会允许，基金管理人、基金注册登记机构、基金代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

⑧）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

4、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集时，由基金托管人召集；

③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，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

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，并书面告知提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

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，单独或合计代表基金份额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日报中国证监会备案。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确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、会议通知

①）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前40天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

a.会议召开的时间、地点、方式和会议形式；

b.会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；

c.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；

d.授权委托书的内容要求（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；

e.会务常设联系人姓名及联系电话；

f.出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

g.召集人需要通知的其他事项。

②）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见提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到指定地点对书面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到指定地点对书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

6、基金份额持有人出席会议的方式

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和监管机关允许的其他方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

①）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或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议程：

a.亲自出席会议者出具的身份证明及持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的身份证明、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注册登记机构提供的的登记资料相符；

b.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50%（含50%）。

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在表决截至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基金管理人规定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：

a.会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

b.召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

c.本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见的，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50%（含50%）；

d.上述第c项中直接出具书面表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面表决意见的代理人，同时提交的身份证明、持有基金份额的凭证、受托出具书面表决意见的代理人出具的身份证明、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，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具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；

e.会议通知公布前报中国证监会备案。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

③）在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式由基金份额持有人对其代表进行授权或召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

7、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、决定终止《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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。

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日30天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日30天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a.关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

b.程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

②）议事程序

a.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，由基金托管人授权其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50%以上（含50%）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主持人。基金管理人和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）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

b.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。

8、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50%以上（含50%）通过方为有效；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。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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，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，符合会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面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项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

9、计票

①）现场开会

a.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，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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。

b.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。

c.如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于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。

d.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拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

10、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5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体上公告。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，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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。

（五）基金合同的变更

1、按照法律法规或《基金合同》的规定，对《基金合同》的变更应当召开基金份额持有人大会的，《基金合同》变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准。

2、上述对《基金合同》变更事项自中国证监会核准之日起生效，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体公告。

3、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，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：

①）调低基金管理费、基金托管费；

②）法律法规要求增加的基金费用的收取；

③）在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式，或调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

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变化；

⑥）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

4、法律法规对《基金合同》变更另有规定的，从其规定。

（六）基金合同的终止

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的；

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；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（七）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止情形之日起30个工作日内成立清算小组，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、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）出现《基金合同》终止情形后，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）对基金财产进行分配。

（八）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。

5、基金财产清算剩余资产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

①）支付清算费用；

②）交纳所欠税款；

③）清偿基金债务；

④）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（①）-（③）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（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《基金合同》终止情形发生并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。

8、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）争议的处理和适用的法律

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的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

（九）基金合同的存放及查阅方式

《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

二十一、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：易方达基金管理有限公司

住所：广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室

法定代表人：梁棠

成立时间：2001年4月17日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字［2001］4号

注册资本：壹亿贰千万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

电话：020-38797888

传真：020-38799488

联系人：邱毅华

2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：姜建清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：赵会军

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币349,018,545,827元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发［1983］146号）

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

①）基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括创业板ETF、创业板指数成份股及备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、货币市场工具、权证、股指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。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

②）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金资产中投资于创业板ETF的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%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a.基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；

b. 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，债券回购到期后不展期；

c.本基金资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；

d.本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

e.本基金投资于股指期货的，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%；在任何交易日日终，持有的买入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100%，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；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%；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%；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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

f.本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

g.本基金持有单个流通受限证券，其市值不得超过本基金资产净值的百分之三；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过本基金资产净值的百分之十；因流通受限证券价格波动、基金规模变动等基金管理人无法控制的因素导致上述比例被动超标的，基金管理人应当停止主动买入流通受限证券或在流通受限期结束后卖出流通受限证券。经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

h.相关法律法规以及监管部门规定的其他投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和应对措施，便于基金托管人实施交易监督。

4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

5）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

③）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

1）承销证券；

2）向他人贷款或提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）买卖其他基金份额，但本基金投资目标ETF或者法律法规或监管部门另有规定的除外；

5）向基金管理人、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债券；

6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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，但本基金投资目标ETF除外；

7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

④）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单更更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

⑤）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1）基金托管人按以下方式依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

2）基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，基金托管人不承担责任。

3）基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。

⑥）基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的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涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

⑦）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行