(上接A31版)

7)基金的管理费、托管费和销售服务费等带来的跟踪误差;
8)指数成分股停牌、摘牌、成份股涨、跌停板等因素带来的偏差;
9)基金管理人的买入卖出时机选择;
10)其他因素带来的偏差。
(4)标的指数变更的风险
根据基金合同的规定,因标的指数的编制与发布等原因,导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准,本基金可能变更标的指数,基金的投资组合随之调整,基金收益风险特征可能发生变化,投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。
(5)互联网公司未能及时、有效、准确提供数据的风险
中证360互联网+大数据100指数由中证指数有限公司与大成基金管理有限公司、北京奇虎三六零投资顾问有限公司联合编制。互联网公司即北京奇虎三六零投资顾问有限公司在中证360互联网+大数据100指数的合作中负责大数据原始数据的提供。因此,本基金存在互联网公司未能及时、有效、准确提供数据的风险。若互联网公司未能及时、有效地提供相关原始数据,中证360互联网+大数据100指数对市场情绪反应的时效性将可能受到影响,进而可能影响本基金的业绩表现;若互联网公司未能准确地提供相关原始数据,中证360互联网+大数据100指数可能无法准确地反应市场情绪的变化,进而可能影响本基金的业绩表现。
(6)基金管理人主动量化选股模型存在失效导致基金表现不佳的风险
本基金为策略指数基金,所跟踪的中证360互联网+大数据100指数为策略指数。基金管理人通过主动量化选股模型确定指数编制策略。中证360互联网+大数据100指数对样本空间的股票,通过对原始数据进行处理加工计算得到财务因子得分、市场驱动因子得分和大数据因子得分,并将三个因子得分进行模型优化,最终确定初始样本股。因子模型和优化模型的构建与计算是由基金管理人采用量化投资策略确定的。因此,本基金存在基金管理人主动量化选股模型失效导致基金表现不佳的风险。当基金管理人主动量化选股模型失效时,本基金的业绩表现可能受到影响。并且,指数的历史业绩仅能代表过去选股策略的结果,并不能代表指数和本基金未来的表现。
(六)本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险
本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和代销机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

十七、基金合同的变更、终止与基金财产清算

(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后方可执行,自决议生效后两个工作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。
(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)《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。

十八、基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
(一)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)依法募集基金;
(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)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)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,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、转换和非交易过户的业务规则;
(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)依法募集基金,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;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基法法》、《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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)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并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)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)基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)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,基金托管人的义务包括但不限于:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(3)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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;
(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《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)建立并保存基金份额持有人名册;
(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14)依据基金管理人的指令或有关规定向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份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;
(17)参加基金财产清算小组,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,并通知基金管理人;
(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《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定;
(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。
(三)基金份额持有人的权利与义务
基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)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,基金份额持有人的义务包括但不限于:
(1)认真阅读并遵守《基金合同》;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)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;
(5)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;
(6)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;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)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,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金未设立基金份额持有人大会日常机构,本基金可根据运作需要依据相关法律法规以及监管机构有关规定增设基金份额持有人大会日常机构。
(一)召开事由
1、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》(法律法规、中国证监会另有规定的除外);
(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(法律法规、中国证监会另有规定的除外);
(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准(但法律法规要求提高该等报酬标准的除外);
(6)变更基金类别(法律法规、中国证监会另有规定的除外);
(7)本基金与其他基金的合并(法律法规、中国证监会另有规定的除外);
(8)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规、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)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、在符合法律法规以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下,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)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金财产承担的费用;
(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》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
(4)基金管理人、基金登记机构、基金销售机构、在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、质押等业务规则;
(5)在法律法规规定或中国证监会许可的范围内基金推出新业务或服务;
(6)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下,增加或减少份额类别,或调整基金份额分类办法及规则;
(7)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,本基金在交易所上市交易、申购和赎回;
(8)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
(9)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;
(10)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以外的其他情形。
(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,应当向基金托管人提出书面提议。
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。
(三)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:
(1)会议召开的时间、地点和会议形式;
(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(包括但不限于代理人身份,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进行表决的情况下,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、书面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到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。
(四)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或通讯开会方式等法律法规或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:
(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委托人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50%(含50%);参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,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)基金份额的持有人参加,方可召开。
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或者在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人采用网络、电话、短信或其他方式,在表决截至日以前对表决事项进行投票并由召集人予以记录。通讯开会应以书面方式进行表决,若基金份额持有人采取非书面形式进行投票的,则召集人对于其投票的书面记录即视为该基金份额持有人的书面表决意见。
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;
(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,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%);参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,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)基金份额的持有人参加,方可召开。
(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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,并与基金登记注册机构记录相符;
(5)会议通知公布前报中国证监会备案。
(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、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发时公告。
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。
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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。若法律法规监管机构出台新要求,以届时有效的方式处理。
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。
(七)计票
1、现场开会
(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。
(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。
(八)生效与公告
基金份额持有人大会的决议,自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会按照《证券投资基金法》第八十七条的规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。
基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。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。
(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,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人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,本基金每年收益分配次数最多12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,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、每一基金份额享有同等分配权;
5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。
(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个工作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,不足于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。
四、基金的费用与税收
(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、基金合同生效后的标的指数许可使用费
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用(包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费);
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的开户费用、账户维护费用;
10、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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.8%÷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
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等,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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.1%÷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
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等、支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类中第4-10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。
3、基金合同生效后的标的指数许可使用费
本基金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支付。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提,计算方法如下:
H=E×0.02%÷当年天数
H 为每日应计提的标的指数许可使用费
E 为前一日的基金资产净值
自基金合同生效之日起,基金标的指数许可使用费按季支付。根据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规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币50,000元(即不足50,000元部分按照50,000元收取)。但基金合同生效当季,标的指数许可使用费不设下限,按实际计提的金额支付。
如与指数编制方的指数使用许可协议约定的收费标准、支付方式等发生变更,按照变更后的费率、支付方式执行,此项变更无需召开基金份额持有人大会。
(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。
(五)基金管理费和基金托管费的调整
经基金管理人和基金托管人协商一致,基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。
五、基金财产的投资方向和投资限制
(一)投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证360互联网+大数据100指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具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。
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:
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于90%,其中,投资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,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。在任何交易日日终,参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%,证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算。
(2)本基金投资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。基金管理人在通知基金托管人后,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。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核核心存款银行是否在名单内列明。
6、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》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
(3)基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。
基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确