（上接A17版）

基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的风险管理体系

本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类，其中，投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系。

1、风险管理原则

基金管理人风险管理体系的构建遵循以下六项基本原则：

（1）营造良好的风险管理文化和内部控制环境，使风险意识贯穿到每位员工、各个岗位和经营管理的各个环节。

（2）建立完善的风险管理组织体系，切实保证风险管理部门的独立性和权威性，使其有效地发挥职能作用。

（3）确保风险管理制度的严肃性，保证风险管理制度在投资管理和经营活动过程中得到切实有效的执行。

（4）运用合理有效的风险指标和模型，实现风险事前配置和预警、事中实时监控、事后评估和反馈的全程嵌入式投资风险管理模式。

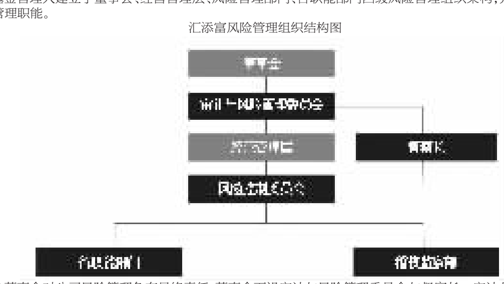
（5）建立和推进员工职业守则教育和专业培训体系，确保员工具备良好的职业操守和充分的职责胜任能力。

（6）建立风险事件学习机制，认真剖析各类风险事件，汲取经验和教训，不断完善风险管理体系。

2、风险管理组织架构

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

汇添富风险管理组织结构图



（1）董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设审计与风险管理委员会与督察长。审计与风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

（2）经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

（3）稽核监察部是风险管理的职能部门。稽核监察部负责投资组合市场风险、信用风险、流动性风险、合规风险、营运风险、道德风险等的管理。

（4）各职能部门负责从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

3、风险管理内容

本基金管理人的风险管理包括风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告等内容。

（1）风险识别是指对现实以及潜在的各种风险加以判断、归类和鉴定风险性质的过程。

（2）风险测量是指估计和预测风险发生的概率和可能造成的损失，并根据这两个因素的结合来衡量风险大小的程度。

（3）风险控制是指采取相应的措施，监控和防止各种风险的发生，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减轻损失。

（4）风险评价是指分析风险识别、风险测量和风险控制的执行情况和运行效果的过程。

（5）风险报告是指将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告的过程。

六、基金管理人的内部控制制度

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

1、内部控制目标

（1）保证基金管理人经营运作遵守国家法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现持续、稳定、健康发展。

（3）确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。

2、内部控制原则

（1）健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则。通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制的有效执行。

（3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。

（4）相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制内容

基金管理人的内部控制要求建立：不相容职务相分离的机制、完善的岗位责任制、规范的岗位管理措施、完整的信息资料保全系统、严格的授权控制、有效的风险防范系统和快速反应机制等。

基金管理人遵守国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的内容包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制以及内部稽核控制等。

（1）投资管理业务控制

基金管理人通过规范投资业务流程，分层次强化投资风险控制。公司根据投资管理业务不同阶段的性质和特点，制定了完善的管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险，分别采取不同措施进行控制。

针对投资研究业务，基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资研究部制度》，对研究工作的业务流程、研究报告质量评价，研究与投资的交流渠道等都做了明确的规定；对于投资决策业务，基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》，保证投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的要求，同时设立了汇添富投资风险评估与管理制度以及投资管理业绩评价体系；对于基金交易业务，基金管理人将实行集中交易与防火墙制度，建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施，交易流程将严格按照"审核—执行—反馈—复核—存档"的程序进行，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。

（2）信息披露控制

基金管理人通过完善信息披露制度，确保基金份额持有人及时完整地了解基金信息。基金管理人按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立了《汇添富基金管理股份有限公司信息披露管理制度》，指定了信息披露责任人负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布，并将定期对信息披露进行检查和评价，保证公开披露的信息真实、准确、完整。

（3）信息技术系统控制

基金管理人建立了先进的信息技术系统和完善的信息技术管理制度。基金管理人的信息技术系统由先进的计算机系统构成，通过了国家、金融行业软件工程标准的认证，并有完整的技术资料。基金管理人制定了严格的信息技术岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，对电子信息数据进行即时保存和备份，重要数据实行异地备份并且长期保存，确保了系统可靠、稳定、安全地运行。在人员控制方面，对信息技术人员进行有关信息系统安全的统一培训和考核；信息技术人员之间定期轮换岗位。

（4）会计系统控制

基金管理人通过建立严格的会计系统控制措施，确保会计核算正常运转。基金管理人根据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册。通过事前防范、事中检查、事后监督的方式发现、堵截、杜绝基金会计核算中存在的各种风险。具体措施包括：采用了目前最先进的基金核算软件；基金会计严格执行复核制度；基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式；每日制作基金会计核算估值系统电子数据的备份，同时打印保存书面的记账凭证、各类会计报表、统计报表，并由专人保存原始记账凭证等。

（5）内部稽核控制

基金管理人通过建立独立的监察稽核制度，确保内部控制的有效性。基金管理人设立督察长，督察长可以列席基金管理人召开的任何会议，调阅相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

另外，在经营管理层设立稽核监察部门，配备充足合格的稽核监察人员，并制订了《汇添富基金管理股份有限公司稽核监察制度》，明确规定了稽核监察部门及内部各岗位的职责和工作流程，监督各业务部门和人员遵守法律、法规和规章的有关情况；检查各业务部门和人员执行内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

4、基金管理人关于内部控制制度声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部风险控制制度。

第四部分基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005年11月02日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币61亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2015】219号

联系人：谢小华

联系电话：010－85159352

中信建投证券成立于2005 年11 月2 日，是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京，注册资本61 亿元，在全国30 个省、市、自治区设有205 家营业网点，并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投（国际）金融控股有限公司、中信建投基金管理有限公司等4 家子公司。自成立以来，中信建投证券各项业务快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力，中信建投证券主要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有7 年以上的证券基金后台运营或结算托管工作经验，其中多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

（三）证券投资基金托管情况

中信建投证券于2015 年2 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，中信建投证券始终遵循"诚信、专注、成长、共赢"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。截止2016 年9 月末，中信建投证券托管3 只证券投资基金。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制组织结构

中信建投证券设有风险管理委员会，负责全公司风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

中信建投证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保障托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

第五部分相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、场外销售机构

（1）直销机构

1）汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932823

传真：（021）28932998

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400－888－9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

2）汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

（2）其他场外销售机构

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

2、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：010－58598839

传真：010－58598907

联系人：朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：吴港平

住所：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16层

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16层

邮政编码：100738

公司电话：（010）58153000

公司传真：（010）85188298

签章会计师：陈露、陈军

业务联系人：陈露、陈军

第六部分基金的募集

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》等有关法律法规以及基金合同的规定，经中国证监会证监许可【2017】1758号文件准予注册募集。

一、基金的类型及存续期间

1、基金类型：股票型发起式证券投资基金

2、基金运作方式：上市契约型开放式（LOF）

3、存续期间：不定期

4、本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：

1）在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。

2）从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式分别为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。在符合相关法律法规和基金份额上市条件的前提下，本基金管理人将在基金合同生效后申请本基金某类或多类基金份额在上海证券交易所上市交易。

根据基金运作情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商，在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平或收费方式、或者增加新的基金份额类别等，调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

5、未来条件许可情况下的基金模式转换

若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可使本基金采取ETF联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会。

二、基金份额的募集期限、募集对象、募集方式及场所

1、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、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人。

3、募集方式及场所

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

场外将通过基金管理人的直销机构及基金销售机构的销售网点或按基金管理人直销机构、销售机构提供的其他方式办理公开发售。投资者还可以登录基金管理人网站（www.99fund.com）办理开户、认购等业务，网上交易开通流程、业务规则请登录基金管理人网站查询。

场内将通过具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所及其指定的登记机构认可的会员单位发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于上海证券交易所会员的其他机构，可在本基金份额上市后通过上海证券交易所交易系统办理本基金份额的上市交易。

销售机构的具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告。

通过场外认购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人上海证券账户下。

募集期间，基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并予以公告。具体销售城市（或网点）名单和联系方式，请参见本基金的基金份额发售公告以及当地基金销售机构以各种形式发布的公告。

三、基金份额的认购

除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

1、基金份额的发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

2、认购费用

（1）场外认购费用

投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。投资者在认购A类基金份额时支付认购费用，认购C类基金份额不支付认购费用。本基金A类基金份额的场外认购费率如下：

认购金额（M）	认购费率
M＜50万元	0.60%
50 万元≤M＜100万元	0.40%
M≥100万元	1000元/笔

基金认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按相关监管部门要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金认购费率。

（2）场内认购费用

本基金的场内认购费率参照场外认购费率执行。

3、认购基金份额的计算

本基金C类基金份额不收取认购费，A类基金份额认购采用金额认购的方式，认购金额包括认购费用和净认购金额。

（1）场外认购基金份额的计算

1）场外认购A类基金份额

认购费用＝认购金额×认购费率/（1＋认购费率）

（对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场外认购A类基金份额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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。认购利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例：某投资者投资100,000元通过场外认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，其对应的认购费率为0.60%，则其可得到的认购份额为：

认购费用＝100,000×0.60%/（1＋0.60%）=596.42元

净认购金额=100,000－596.42=99,403.58元

认购份额=99,403.58/1.00=99,403.58份

利息转份额=10/1.00=10.00份

总认购份额=99,403.58+10.00=99，413.58份

即：投资者投资100,000元通过场外认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到99，413.58份A类基金份额。

2）场外认购C类基金份额

认购份额=认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场外认购C类基金份额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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。认购利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例：某投资者投资100,000元通过场外认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，无认购费率，则其可得到的认购份额为：

认购份额=100,000/1.00=100,000.00份

利息转份额=10/1.00=10.00份

总认购份额=100,000.00+10.00=100,010.00份

即：投资者投资100,000元通过场外认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到100,010.00份C类基金份额。

（2）场内认购份额的计算

1）场内认购A类基金份额

本基金认购A类份额的计算公式为：

认购费用＝认购金额×认购费率/（1＋认购费率）

（对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场内认购A类基金份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者；认购利息折算的基金份额按截位法保留到整数位，小数部分舍去归基金资产。

例：某投资者投资100,000元通过场内认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，其对应的认购费率为0.60%，则其可得到的认购份额为：

认购费用＝100,000×0.60%/（1＋0.60%）=596.42元

净认购金额=100,000－596.42=99,403.58元

认购份额=99,403.58/1.00=99,403.58份（四舍五入保留到小数点后两位）=99,403份（保留至整数位）

利息转份额=10/1.00=10份（保留至整数位）

（下转A19版）

（上接A17版）

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，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的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2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，基金管理人经与基金托管人协商一致，并报监管机关并提前公告后，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、基金份额收益原则、执行方式

（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，本基金可进行基金收益分配；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。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海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；

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

（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。对于场外份额，当投资者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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为对应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海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。

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、销售服务费：本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

4、基金标的指数许可使用费；

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、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、期货交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、基金的上市费及年费；

11、基金的开户费用、账户维护费用；

12、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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

3、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年费率为0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日C 类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，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付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

4、基金的指数许可使用费

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

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送标的指数指数使用许可费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币1万元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费费率、具体计算方法及支付方式。

上述"一、基金费用的种类"中第5－12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。

（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、基金的投资

（一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争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）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%；本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定的从其规定；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

（12）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；

（13）本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（14）本基金参与股指期货和国债期货交易，应当遵守下列要求：

1）本基金在任何交易日日终，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%；持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

5）本基金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%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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30%。

（15）因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

（16）本基金参与融资，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

（17）本基金参与转融通证券出借交易，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；

（18）本基金投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资，法律法规另有规定的，从其规定；

（19）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交易对手方开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

（20）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（21）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）、（10）、（18）、（19）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规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。上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、禁止行为

为维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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，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利益优先的原则，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的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交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。

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。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

（一）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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值；

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

（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；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）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）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

（4）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、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，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、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值，估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

6、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7、本基金投资股指期货合约，按估值日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

9、本基金投资股票期权合约，一般以股票期权当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

10、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、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。

12、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。

（二）估值程序

1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类别基金资产净值除以当日发售在外的该类别基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于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。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。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，由基金管理人按规定对外公布。

3、当本基金发生大额申购或赎回情形时，经与基金托管人协商一致，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并依照《信息披露办法》的有关规定，将摆动定价机制的具体操作规则在指定媒介上公告。如法律法规或行业协会今后另有规定的，从其规定。

（三）基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值

《基金合同》生效后，在本基金上市交易或开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在本基金上市交易或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个交易日/开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日/开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

七、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、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金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生效后方可执行，自决议生效后2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）对基金剩余财产进行分配。

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。

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》有关的一切争议可通过友好协商解决，如未能协商解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同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、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

（上接A17版）

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场外认购A类基金份额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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。认购利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例：某投资者投资100,000元通过场外认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，其对应的认购费率为0.60%，则其可得到的认购份额为：

认购费用＝100,000×0.60%/（1＋0.60%）=596.42元

净认购金额=100,000－596.42=99,403.58元

认购份额=99,403.58/1.00=99,403.58份

利息转份额=10/1.00=10.00份

总认购份额=99,403.58+10.00=99，413.58份

即：投资者投资100,000元通过场外认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到99，413.58份A类基金份额。

2）场外认购C类基金份额

认购份额=认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场外认购C类基金份额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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。认购利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例：某投资者投资100,000元通过场外认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，无认购费率，则其可得到的认购份额为：

认购份额=100,000/1.00=100,000.00份

利息转份额=10/1.00=10.00份

总认购份额=100,000.00+10.00=100,010.00份

即：投资者投资100,000元通过场外认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到100,010.00份C类基金份额。

（2）场内认购份额的计算

1）场内认购A类基金份额

本基金认购A类份额的计算公式为：

认购费用＝认购金额×认购费率/（1＋认购费率）

（对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额=净认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场内认购A类基金份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者；认购利息折算的基金份额按截位法保留到整数位，小数部分舍去归基金资产。

例：某投资者投资100,000元通过场内认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，其对应的认购费率为0.60%，则其可得到的认购份额为：

认购费用＝100,000×0.60%/（1＋0.60%）=596.42元

净认购金额=100,000－596.42=99,403.58元

认购份额=99,403.58/1.00=99,403.58份（四舍五入保留到小数点后两位）=99,403份（保留至整数位）

利息转份额=10/1.00=10份（保留至整数位）

总认购份额=99,403+10=99,413份

返还资金=0.58元

即：投资者投资100,000元通过场内认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到99,413份A类基金份额，向投资者返还0.58元。

2）场内认购C类基金份额

认购份额=认购金额/基金份额发售面值

利息转份额=利息/基金份额发售面值

总认购份额=认购份额+利息转份额

场内认购C类基金份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者；认购利息折算的基金份额按截位法保留到整数位，小数部分舍去归基金资产。

例：某投资者投资100,000元通过场内认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，无认购费率，则其可得到的认购份额为：

认购份额=100,000/1.00=100,000份（保留至整数位）

利息转份额=10/1.00=10份（保留至整数位）

总认购份额=100,000+10=100,010份

返还资金=0元

即：投资者投资100,000元通过场内认购本基金C类基金份额，假设其认购资金在认购期间产生的利息为10元，则可得到100,010份C类基金份额，无需向投资者返还资金。

四、场内认购的程序

1、业务办理时间：2017年11月8日起至2017年11月28日9:30－11:30和13:00－15:00（周六、周日和法定节假日不受理）。

2、开户及认购手续：

（1）开立上海证券账户，包括人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

（2）在通过上海证券交易所内具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位营业部开立资金账户，并在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

（3）投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，具体业务办理流程及规则参见场内代销机构的相关说明。

五、场外认购的程序

（一）使用账户说明及注意事项

1、使用账户说明

投资者通过场外认购本基金应使用中国证券登记结算有限责任公司的上海开放式基金账户。

（1）已有上海证券账户（人民币普通股票账户或证券投资基金账户）的投资者，不需要重新办理上海开放式基金账户的开户，可直接办理账户注册，即将已有的上海证券账户注册为上海开放式基金账户。

（2）尚无上海证券账户（人民币普通股票账户或证券投资基金账户）的投资者，可直接办理上海开放式基金账户的开户，中国证券登记结算有限责任公司将为其配发上海证券投资基金账户，同时将该账户注册为上海开放式基金账户。

对于配发的上海证券投资基金账户，投资者可持基金管理人或代销机构提供的账户配号凭条，到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构打印上海证券投资基金账户卡。

（3）已通过直销网点或本基金管理人指定的代销机构办理过上海开放式基金账户注册手续的投资者，可在原处直接认购本基金；如拟通过其他代销机构或直销网点认购本基金的，须用上海开放式基金账户在新的代销机构或直销网点处办理开放式基金账户注册确认。

2、账户使用注意事项

（1）投资者已持有的汇添富基金管理有限公司的基金账户不能用于认购本基金；若已开立中国证券登记结算有限责任公司的上海开放式基金账户的投资者，可直接认购本基金。

（2）拥有多个上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户的投资者，只能选择其中一个注册为上海开放式基金账户。为了日后方便办理基金份额跨系统转托管，建议投资者通过上海证券交易所认购、申购与赎回及买卖上市开放式基金也只使用该注册账户。

（3）对于通过中国证券登记结算有限责任公司配发上海证券投资基金账户的投资者，为了日后方便办理基金份额跨系统转托管，建议投资者通过上海证券交易所认购、申购与赎回及买卖上市开放式基金也只使用该配发账户。

六、直销中心的开户与认购流程

（一）注意事项

1、投资者应按《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书》规定的程序办理相关事项。

2、投资者可以使用银行转账、本票等主动付款方式进行认购缴款。

3、通过直销中心开立基金及交易账户的基金投资者应指定一个银行账户作为其资金交收账户，以便进行认（申）购缴款、赎回、分红及无效认（申）购资金退款的资金结算。资金交收账户的名称必须与投资者开立基金账户的名称一致。

4、营业时间：基金发售日的9:00－17:00。

5、个人或机构投资者如需通过直销中心认购基金，请尽早向直销中心索取或从本公司网站(www.99fund.com)下载开户、认购申请表单及相关资料。

6、直销中心与代理销售网点的申请表格式不同，投资者请勿混用。

（二）开户及认购程序

1、开户

（1）投资者可以到直销中心办理开户手续。开户资料的填写必须真实、准确，完整，否则由此引起的客户资料寄送等错误的责任由投资者自行承担。

（2）选择在直销中心认购基金的投资者应申请开立基金账户（已开户者除外），投资者开立基金账户的同时将获得基金交易账号。

（3）个人投资者：填写《基金账户业务申请表》及《风险提示函与自测表》，同时提交下列材料：

1）有效身份证件原件及正反面复印件；

2）银行借记卡或存折原件及复印件。

个人投资者如委托代理人办理，则另须提供代理人有效身份证件原件及正反面复印件，并由双方填写《基金授权委托书》。

（4）机构投资者：填写《基金账户业务申请表》并加盖机构公章及法定代表人私章，同时提供下列材料：

1）加盖机构公章的《机构投资者风险承受能力评估问卷》；

2）加盖机构公章的法人营业执照、组织机构代码证及税务登记证复印件；

3）加盖机构公章和法定代表人私章的《基金授权委托书》；

4）加盖机构公章的《预留印鉴卡》；

5）加盖公章及法定代表人私章的《传真交易协议书》；

6）加盖公章的法定代表人有效身份证件正反面复印件；

7）加盖公章的机构经办人有效身份证件正反面复印件；

8）加盖公章的预留银行账户的开立证明文件复印件。

（5）投资者T日提交的开户申请，可于T+2日起通过本公司直销中心或客服热线（400－888－9918）查询申请结果。

2、缴款

（1）投资者申请认购本基金，应首先将足额认购资金以银行认可的付款方式划入本公司指定的直销资金专户：

账户一：

账户名称：汇添富基金管理股份有限公司直销专户

开户银行：浦发银行卢湾支行

银行账号：98990153850000015

人行支付系统行号：310290000290

账户二：

账户名称：汇添富基金管理股份有限公司直销专户

开户银行：招商银行上海徐家汇支行

银行账号：121902331810623

人行支付系统行号：308290003100

账户三：

账户名称：汇添富基金管理股份有限公司直销专户

开户银行：中国工商银行上海分行营业部

银行账号：1001202929025807250

人行支付系统行号：102290024433

（2）投资人在办理汇款时必须注意以下事项：

投资者应在"汇款人"栏中填写其在直销网点开立基金账户时登记的姓名；

投资者应在"汇款备注栏"或"用途栏"中准确填写其在直销网点的交易账号，因未填写或填写错误导致的认购失败或资金划转错误由投资者承担。

3、认购

已全额缴款并完成开户申请的投资者，可以办理认购申请并提交下列材料：

（1）《基金交易业务申请表》；

（2）投资者或代理人身份证原件及正反面复印件；

（3）加盖银行受理章的银行缴款凭证。

投资者的认购申请均为当日有效，如在规定时间内认购款未到账将视为无效申请。投资者则需另外提交认购申请。

投资者T日提交的认购申请，可于T+2日起通过本公司直销中心或客服热线（400－888－9918）查询申请结果。

七、销售网点的开户与认购流程

投资者在其他销售机构办理本基金认购业务，具体开户与认购流程请遵循相关销售机构的规定。

八、清算与交割

本基金募集期间，全部认购资金将被冻结在本基金登记机构的基金认购专户中，投资者的认购资金在基金募集期间形成的利息，在基金合同生效后折算成基金份额，归投资者所有。

本基金份额的权益登记由本基金登记机构在募集结束后完成注册登记。

九、募集费用

本次基金募集过程中所发生的与基金有关的法定信息披露费、会计师费和律师费等募集费用从基金认购费用中列支，不从基金财产中支付。若在募集期结束时，基金仍不能满足法定备案条件，则募集费用由基金管理人承担。

十、基金的验资与备案

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，由基金管理人委托具有资格的会计师事务所对认购资金进行验资并出具验资报告，基金登记机构出具认购户数证明。

若基金符合法定备案条件，基金管理人办理基金备案手续后，发布基金合同生效公告。

若基金不符合法定备案条件，本基金管理人承担全部募集费用，并将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内划出，退还基金认购人。

十一、本次募集当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：汇添富基金管理股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼21－23楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932888

传真：（021）28932998

网址：www.99fund.com

电子邮件：service@99fund.com

（二）基金托管人

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005年11月02日

联系人：谢小华

联系电话：010－85159352

（三）销售机构

1、A类份额场外销售机构

（1）直销机构

1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932823

传真：（021）50199035

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400－888－9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

（2）其他场外代销机构

1）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005年11月02日

联系人：谢小华

联系电话：010－85159352

网址：www.csc108.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

2、C类份额场外销售机构

（1）直销机构

1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932823

传真：（021）50199035

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400－888－9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

（2）其他场外代销机构

1）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005年11月02日

联系人：谢小华

联系电话：010－85159352

网址：www.csc108.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

3、场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可通过上海证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。基金管理人将不就此事项进行公告。

（四）基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系电话：010－58598839

传真：010－58598907

联系人：朱立元

（五）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

（六）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：吴港平

住所：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16层

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16层

邮政编码：100738

公司电话：（010）58153000

公司传真：（010）85188298

签章会计师：陈露、陈军

业务联系人：陈露、陈军

汇添富基金管理股份有限公司

2017年10月26日