(上接A22版) 三、募集方式和募集场所 投资人可选择网上现金认购,网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。 网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。 网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。 投资人应当在基金管理人及抵抗定发售代理机构为理基金发售业务的营业场所,或者按基金管理人或发售代 构媒体的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式,请 基金份额发售公告。

##巡目##八刊IK#B共同FIPOU智報、受型及售代理机构,并另行公告。 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认 [纪机构的确认结果为准。对于认购申请及认购金额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利。 四、募集对象

RM家 律法规规定的可投资干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

和日本年6888年11月7日,由北州政风盛亚月广入政风有《明明政风 国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 五、基金份额发售面值、认购价格 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

一大认购开户"
投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户(以下简称"证券账户")。
已有上海A股帐户或证券投资基金账户的投资者不必用办理开户手续。
但为上海A股帐户或证券投资基金账户的投资者不必用办理开户手续。
尚无上海A股帐户或证券投资基金账户的投资者,需在认购的体本人身份证到中国证券登记结算有限责任公上海分公司的开户代理财务更重上海A股账户或证券投资基金账户的具体程序和办法。请到各开户网点详知咨询有关规定。
(1)如投资人需新开立证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人使用本基金标。
由上海证券交易所正常投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人使用本基金标。
由发政成份股中的上海证券交易所上市股票需要参与网下股票认购或基金的申购。赎回,则应开立上海及股账户;投资人需要使用本基金标的指数成份股中的深圳证券交易所上由股票等。

1所A股账户。 ②开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。 (2)如投资人已开立上海证券账户,则应注意: ①如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在现本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在现本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易于统。 ②当日办理指定交易于统。 定交易或转相定交易于统。

七、认购费用 本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由投资人承担,认购费用不列人基金财产,主要用于基金的市场 、銷售、登记等发售期间发生的各项费用。认购费率如下表所示 认购费率

M = 100万份 每笔00元 基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。基金管理人办理网下股票认购、发售代理 势办理网上现金认购,网下现金认购,网下股票认购时可参照上还费举结构,按照不高于0.08%的标准收取一定 程用。投资者申请重复现金认购的,须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。 (、网上现金认购) 1.认购的时间;许见基金份额发售公告。 9.认购公量公债

2、XX-20-2013日 通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购佣金和认购金额的计算公式为: 认购佣金 = 认购价格×认购份额×佣金比率

认购用金 = 认购价格文认购价额×佣金比率 认购的编章、以购价额×(1+佣金比率) 认购佣金由按售代理机构向投资人收取、投资人需以现金方式交纳认购佣金。 3、认购限额。网上现金认购以基金价额申请。单一账户每笔认购价额需为1000份或其整数倍。最高不得超过 999,000份,投资者可以多次认购。累计认购价额不设上限。 4、认购于续、投资人在认购本基金时,需按发售代理机构的规定、备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购 经过去户。初处,再以作为与以至自即的有数等的实验的。如此事

4、以時子後,这次人可以在当日交易的间内横侧前途的认购申请。 接受后,接领人可以在当日交易的间内横侧前途的以购申请。由该发售代理机构冻结相应的认购资金,登记 5、海算交收,江日延过食情代單机停缩之的网上现金认购申请。由该发售代理机构冻结相应的认购资金、登记 进行消算交收,开格有效认购数据发送发售的调人,发售的调人于网上现金认购结束后的第个工作日格实际

3进行清算交织,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作目标采购的认购资金则比基金管理人。 6.认服确认,在基金合同生效后,投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。 1.从网下现金认购。 1.认服时间,详见基金价额发售公告。 2.认购必需和职息折算的分额的计算。 通过基金管理人进行网下现金认购的投资人、认购以基金份额申请、认购费用和认购金额的计算公式为: 认购费用。认购价格、认购价额、以购费率。 从收金额。认购价格、认购价额。 认购费用,以购价额。以购金额产生的利息、从购费率。 从购费用,以购价额。以购金额产生的利息、从多数量。 以购费用用基金管理人用收费人被取、投资人需以现金方式交纳认购费用。 加速设备管理人和收货人被取、投资人需以现金方式交纳认购费用。 加速设备管理机构进行网下现金认购的认购金额的计算问通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额 并成

第3、以购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须00份或其整数倍,投资人通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在5万份认为。但可多次认购,累计认购份额不在5万份。大人可多次认购,累计认购份额不及上限。
《认购与录》设设人在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并备足认购资金。现金认购申请提交后资票撤回以销售机构的规定为据。
"现金认购申请提交后资票撤回以销售机构的规定方据。"由基金管理人干了+2日进行有效认购款项的清算、"将认购资金划人基金管理人规步开设的基金务集专户。支售明结束后,基金管理人将于第4个工作日将汇总、购款项及其利息划任基金募集专户。其中,现金认购款项在发售期内产生的利息将折算为基金份额归投资人

。 T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的 一个工作日,各发售代理机构将每一个投资人帐户提交的网下现金认购申请汇总后,通过上海证券交易所上 价发行系统代级投资人提交网上现金认购申请。2点,接它机场进行清算交收,并将有效认购数据及这及售协 ,发售协调人于两上现金认购结束后的第4个工作日将安冻到位的认购资金划任基金管理人预先开设的表 ,发售协调人于两上现金认购结束后的第4个工作日将安冻到位的认购资金划任基金管理人预先开设的表

专尸。 6.认购确认:在基金合同生效后,投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

6. 消費交收 阿下股票认购期内每日日终,发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券帐户汇总发送给基金管理 阿下股票认购最后一日,基金管理人到步顿认务成份股的有效认购效量、登记机构根据基金管理人提供的确认 解释设行从限户内相似的股票并行款后,基金发展用据结束员。基金管理人根据发售代理用转提化的数据付款 从原以基金份额方式支付的认购用金,并从投资人的认购价额中却原。然后将扣除的认购的金以基金份额的形 返还给金货帐户期料处。登记和根据基金管理人提供的投资人办,服务得明报数据进行投资人认购份额的初的公司 是还给金货帐户期料处。登记和根据基金管理人提供的投资人办,服务得明报数据进行投资人认购份额的初的公司。 1. 卡根据基金管理人根上海证券交易所确认的有效认购股票数据。将投资人申请从购的股票过户到基金的证

5. 民国对外规约会2000年4月

这.20g.为一¹17年1月发空产的比较空间的基本是有一点的40cm的2.20g. *) *****=696.500

其中:
(1) 代表投资人提交认购申请的第1只股票,如投资人仅提交了1只股票的申请,则i=1。(2) "第1只股票在网下股票以购期最后一日的均价"由本基金管理人根据证券交易所的当日行情数据,以该 据的总成全金额除以总成交股数计算,以四舍五人的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则 明年方法计算成正一个交易目的给作为计算价格。
若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生了除息、送股(转增),配 转及强变动,由于投资人获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的 及血炎的,由了这员人系传了"由是的农血",需要自然人情况的。 北行调整: 1)除息:调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 – 每股现金股利或股息 2)送股:调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 / (1 + 每股送股比例)

配股比例) 5) 除息、送股且配股:调整后价格 =(网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 – 每股现金股利或 (.) / (1+每股这股比例+每股配股比例) (3) "有效认购效量"是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。其中: ① 对于经公告规则认购规模的个股,基金管理人可确认的认购效量上限为:

gen-trade-2 page blacket day

企業的研究工程表別"是一些業別要素的"(2)、表面。 ● Committee あんだい 無いていなうをもつだけにはは知。

2011年のようでは、大学・大学の大学の大学の大学を表示している。 人名格里 化化物中四下吸中或形形装置一口线的食品或用物物主意物。

 一个學習提供的社會的方式以前的表現的建議時间。一個學學的學術。 三、沙耳科内、九河水 在秦牧 化物效用色点管,则是全管使力的多位管 图域等"无效配位争之法"[[188]]。33. 计逻辑模点(24.7) 1889年。

沙生 キッリザネス。 ・ テスタが軍隊を見事さらればた一日のもくび

)若某一股票在股票认购日至登记机构进行股票过户日的旅结期间发生司法执行,则基金管理人将根据登 I确认的实际过户数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。 认购佣金由发售代理机构在投资者认购商认识协助

2019·阿纳比约实际过广致想对投资者的得效从购数重进行相应调整。
8.认购调查由发售代理机停在投资者认购的认用效似。
9.认购确认:在基金合同生效后,投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。
+一、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的 确认以设定机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况。投资人应及时查询并妥善行使合法权利。
十二、募集资金利息与募集股票权益的处理方式 通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集则而产生的利息,将折离为基金份额已投资者所 ,此中利息转份额以最记电影的行虚为清。根 上级金认取和通过发售代理机构进行网下现金认购的效从购资 全在整订机场销资收货至处,从最全批管中一前产生的利息,计人基金财产、不扩强为投资者基金份额;网下股票 从购所募集的股票在何下股票从购日至整订出成进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。 十二、发行联接基金或增设新的份额类别 未一、发行联接基金或增设新的份额类别 与基金任营、约商一级后,资料等都是依然

第七部分 基金备案

一、基金各案的条件 本基金目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(含网下股票认购所 募集的股票投基金合同约定的估值方法计算的价值)不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下, 基金管型人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验查机构验资,自收到验查 报告之日起10日,向中国证验会办理基金各案手续。 基金募集公司基金合客条件的,自基金管理人办理完毕基金各案于续并取得中国证监会书面确认之日起,《基 金合同3生效、否则《基金合同》5不生处、基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用;网下 股票认购所募集的股票由发售代理机例予以资结。 一、基金合同可作性实效的筹集资金的处理方式 如果募集期限局商。未测量基金备条条件,基金管理人应当承担下列责任: 1,以其固有财产或担因募集行为而产生的费利费用。

以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
 在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息,同时将已冻结的

股票解诉。 3、加基企虧集失败,基金管理人,基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构 为基金磨煤变付之一切费用应由各方各自承租。 三、基金存款期内时基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后,连续20个工作日出职基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情 形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露,连续60个工作日出现前途情形的。基金管理人应当向中国证监会说 則限因报告并报送提出解决方案。如转换运作方式、与基他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人

会进行表决。 法律法规另有规定时,从其规定。

基金管理人应事先确定基金份额折算日,并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

二、基金份經計等的的限則 基金份經計算的出基合管型人向營已机构申请办理,并由營记机构进行基金份經的变更營记。 基金份經計算后,本基金的基金份經总經与基金份鄉持有人持有的基金份經數經將发生調整,但调整后的基 經濟經持有人持有的基金份經濟所來就對盡查第一占基金总統一的比例不及生变化。據以展數处理而产生的损益 基金份經濟等其基金份經濟特人的权益完全與世世經濟、結構日才基金份經濟有人大会审议。基金份經濟算后, 总份經濟有人将依照訂海區的經濟有人的政治完全與世世經濟、結構日基金份經濟有人大会审议。基金份經濟算后, 是份經濟有人将依照訂海區的海金份經享有权利并承担义务。 如果基金份經濟算過程學是不可抗力,基金管理人可延迟外理基金份經濟算。 三、基金份额折算的方法基金份额折算的具体方法在份额折算公告中则示。1、如未来本基金增加基金份额的线别,基金管理人在实施份额折算时,可对全部份额线别进行折算,也可根

需要只对其中部分类别的代码。 需要只对其中部分类别的代码进行行算。如为基金对部分的微类别进行计算,以对生命的对称实别进行订算,让机 权。计算到会或出具表决意见的特有人所代表的基金分割的分额类别进行计算。对于涉及投票权,提出召集 ,所持的额及其占显的统计则,每一份未消费的基金份额可固定比例的上均属基金份额代表间等权利,其他

x____ 效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》,向上海证 基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《上海业券交易所业券投资基金上市规则》,同上海业 肠所申请基金的搬上所。 1.基金募集金额(含募集的股票市值)不低于2亿元。 2.基金份额持有人不少于1,000人; 3.《上海证券交易所产业分级基金。 基金上市前,基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的,基金管理 按照相关规定发布基金上市交易公告书。 - 基金份额已市交易

二、基金份額的上市交易 基金份額在上南证券交易所的上市交易需遵照(上海证券交易所交易规则)、(上海证券交易所证券投资基金 规则)、(上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则)等有关规定。 三、各止上市交易

二、※出工口×勿 基金份被上市交易后,有下列情形之一的,上海证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案: 1、不再具备本条第一款规定的上市条件;

1.不再具备本条第一款规定时及上印录证:
2.基金合同约定的终止;而3.基金分额持有人大会决定期的终止上市,
4.基金分额持有人大会决定期的终止上市的其他情形;
5.上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形;
5.上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形;
5.因证券交易所认为应当终止上市的其他情形。
5.因证券交易所以为应当终止上市的其他情形。
5.因证券交易所终止上市的,本基金可由交易型,
6.还基金变更为跟踪标的捐数的非上市的开放式捐数基金,而无需召开基金份额持有人大会审议。
6.在局途更为见时,这样数据户标。的捐数的捐数基金,则基金管理人将本着维护基金份额持有人合法
2.适的原则,履行当的程序后,均据数基金合并或者违政进位占适的捐数作为标的捐数。
四、基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告
基金管理人存在一交易日开市前的上海证券交易所提供当日的申购赎回清单、上海证券交易所在开市后根据
"购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据,计算并发布基金份额参考净值(IOPV),供投资者交易,申
1 唯问基金份额时参考。

3、孫已經並可確可多等。 1、基金份额参考停值的计算公式: 基金份额参考停值。中期赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中退补现金替代成份 基金份额参考停值。(申购赎回海的压力。 東級之和 + 申购赎回海中学途上用现金替代成份证券的数量与最新成交价乘积之和 + 申购赎回清单中举止用现金替代成份证券的数量与最新成交 2、基金份额参考停值的计算以四含五人的方法 保留小数点后位。 3、上海证券交易所可以则整基金份额参考净值的计算公式,并予以公告 上海证券交易所有以则整基金份额参考净值的计算公式,并予以公告 上海证券交易所有以通路基金份额参考净值的计算方法,并予以公告。 上海证券交易所有以通路基金份额参考净值的计算方法,并予以公告。 九、租注法律规,中国证路会及上海证券交易所对量。上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,基金合相应予以修改,且此项略改无须召开基金份额持有人大会审议。 次是上海证券交易所,可回距券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能,本基金管理人可以在 行适当的程序后增加相应功能。 七、在不过反法律法规的规定及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,本基金可以申请在包括境 交易所在内的良性交易场所上市交易。 第十部分 基金份额的申购与赎回

公亩。 自购、嘘同开始日及业务办理时间

2. 中與,縣回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同性效之日起不超过三个月开始办理申购,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性效之日起不超过三个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 本基金可在基金上市交易之前开始办理申购,赎回,但在基金申请上市期间,可暂停办理申购,赎回。 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 媒介上公告申购与赎回的开始时间。 本基金在基金合同生效后;开放日常申购之前,可向本基金联接基金开通特殊申购,申购价格以特殊申购日的 份额净值力基础计算,投金额申购,不收取与申购相关的费用和成本。

2010年0日以外最低計算。 按金额申购,不收取与申购相关的费用和成本。 三、申申与标印的原则 三、申申与标印的原则 1.本基金采用份额申购和份额赎回的方式、即申购和赎回为以份额申请。 2.申购对价、规回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他站价; 3.申购,被回申请提交员不得撤销。 4.申购,赎回申请提交员不得撤销。 4.申购,赎回进等于是证券更分别所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则和规定。 基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信 强办法》的号表现定在指定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序。

3、中海和聚尼印加到: 、中胸和聚厄的中请方式 投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎

2. 申與和赎回申请的确认 正常情态下,投資人场內投衡申與,赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申與对价, 初分份額申與审请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根期要求准备足额的观查。或基金投 且合戶不具备足额的符合要求的赎回对价,则添为的额赎回申请失败。 销售机构对场份额申购。或回申请的受理未不代表使申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到该申请。 份额申购。赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于场内份额申购,赎回申请的确认情况,投资人应及时 旬并发展行提合法权利。

查询并奖善行他合款权利。
3.申郑军服即的销資之收与登记
本基金申郸赎回过起中涉及的基金份额。组合证券,现金替代、现金差额及其他对价的消算之收适用《上海证本交易所交易型开放式指数基金业务实施组则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记营资业务实施组则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所方旁别型开放式基金登记营资业务实施组则》和参与各方相关协议的有关规定。
并本基金的中期业务采用净额结算和逐毫全额结算相结合的方式,其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,申购当日未卖出的基金份额及对的成别证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,对于本基金的赎回业务未来用净额结算,对于本基金的赎回业务。
来用净额结算和代使代付相给合的方式,其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算,深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用个被任务

金差额的变败。 使资者应按照基金合同的约定和销售机构的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代补款。因投资者应 因导致现金差额成现金替代补款未能按时足额交收的。基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿,并要求其 承担由此导致的其相基金份额持有人或基金资产的损失。 如果登记机料和基金管理人在消算变收时发现不能工常解约的情形,则依据(上海证券交易所交易型开放式 指数基金业务实施细则)、(中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业 各金饰细则。到晚年18年和其代制以的有差型或非否办理

数基金业务实施组则》、《中国证券验记检算有限责任公司关于上海证券交易所交易想开放式基金数记档算业 交施组则》和参与各方相关的议的有关规定进行处理。 基金管理人和稳记机构可在法律法规允许的范围内,在不影响基金份额持有人实质性利益的前提下、对上述 跨赎回的租赁火及清算交收税包记的办理时间,方式、处理规则等进行调整,并在开始实施前按照《信息披露办 3.的有关规定在指定媒介上予以公告。 五、申助和联闭的数量限制 1.参与本基金的日常申购、赎回、需按最小申购、赎回单位的整数倍提交申请。本基金目前的最小申购赎回单 为400万份基金份额。 2.基金管理人可根据基金还仲增及、市场情况和投资人需求。在法律法规允许的情况下、调整量小申购、赎回 位。基本管理人可根据基金还仲增及、市场情况和投资人需求。在法律法规允许的情况下、调整量小申购、赎回 位。其本管理人必然在继续安徽市份据《信息按索办法》的对关并现在方面接接个一次人生共独口可证的金条案

2.基金管理人可根限基金运作符成。市场情况积投资人需求,在还年还规允许的消化下,调整银小甲则,赎回位。基金管理人必须供额交施前依照(信息玻索办法)的有关规定在指定域介上公告并採中国证债各备案。3.当接受申廖申谢对各量基金份额持有人利益物成排在重大不利影响时,基金管理人可以采取规定单个投资者申购份额上限。基金规模上限或基金单日净申购比例上限,以及拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定消参见相关公告。基金管理人可根据基金运作特况,市场情况和投资人需求。在法律法规允许的情况下,调整申购和赎回数量的限制。基金管理人必须证据整定施前依照《信息披露办法》的有关规定括定域介上公告。次,中购和赎回的对价,费用及其用途

承担。工日的基金份额净值在当天収巾后口房,共任1+16以26日。 国证监会备案。 2.申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购,赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购 时应交付的组合证券,现金替代、现金差额及其他对价、赎回对价是指投资人赎回时,基金管理人应交付给投资人 的组合证券,现金替代、现金差额及其他对价。 题回对价是指投资人赎回时,基金管理人应交付给投资人 3.申购赎回清单由基金管理人编制。T目的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。 4.投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.20%的标准收取佣金,其中包含证券交

4、投资者在甲與或赎旧基金份額的、理與限价地券稍可按照不超过0.20%的标准或取佣金,其中包含业券交、 该已用场等收取的相关费用。 基金管理人可以在不违反相关法律法规且不能响基金份额持有人实质性利益的情况下对基金份额净值、申购 清单计算和公告时间进行调整并提前公告。 七、份額申與赎回清单的内容与格式 1、申與赎回清单的内容 百日申與期面清单公告内容包括最小申與、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估 部分、T-1目的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。 24年心率基单扩充等

A. 出口证好相夫内等 组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各 成份证券名称。证券代码及数量。 3.现金替代相关内容

現金者で比例(物) - <u>ラ</u> 一度基金分割(おろ事のの関係す(2089) 91009s

原が任券。
2) 替へ金額、対于必須現金替代的证券、基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的現金、即"固定替金额"。固定替代金額的计算方法为申购赎回清申收证证券的数量乘以其下日开盘参考价。
(3) 退补現金替代
1) 通时附形・退补现金替代的证券目前仅适用于标价指数中深圳证券交易所設票。
2) 替代金額:対于退补现金替代的证券目前仅适用于标价指数中深圳证券交易所設票。
(4) 時代金額:対于退补现金替代的证券目前仅适用于标价指数中深圳证券交易所設票。
(5) 時代金額:対于退补现金替代的证券、替代金额的计算公式为:
申购的替代金额。替代证券效量×该证券调整后 T 日开盘参考份×(1-现金替代溢价比例);
则即的替代金额。每代证券效量×该证券调整后 T 日开盘参考份×(1-现金替代溢价比例)。
3) 替代金额的处理程序。
3. 部代金额的必要程序。

特別实际过来,则基金管型、将追还多收取的差额;如果预先收取的金额低于基金则人该部分业界的头际瓜本,则基金管型人格向投资者被取欠缺的差额。 对追补或金替代而言,既即时扣除现金替代溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人将卖出该证券,实际卖出价格扣除相关交易费用点与该证券调整后下日开盘参考的可能有所差异。为便于操作、基金管理人将自然分证券的实际收入,则基金管理人将追求少支付的差额,如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入,则基金管理人将追求少支付的差额,如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入,则基金管理人将追求少支付的差额,如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的资东收入,则基金管理人将自投资者收取多支付的差额。 其中、调整后了日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。 基金管理人将自己已起作效到申取交易确认后按照"时间优先、实时申报"的原则依次实入申购被替代的部分证券,但未完成的交级,在收到规则已经确认任任度限"时间优先、实时申报"的原则依实证规则包装的成份证券有正常交易的人,但是不是成的交易,基金管理人在"日后被替代的成份证券"有一个实易可。简称为"1-2日)内完成上还发易,目的优先的原则为"由来的原则为"有大量。

现金。 6. 申购赎回清单的格式

GENT CHATTA LATERAL				ILIO-BIGGIAZ EPGEZARO PINAZA PO			
	一级市场基金	金代码		XXXXXX			
		T-	1日信息内容				
现金差額(单位:元)				ххххл			
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)				ххххπ			
基金份额净值(单位:元)				x.xxxx元			
		Т	日信息内容				
最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位:元)				ххххд			
现金替代比例上限				XX%			
申购上限				无			
赎回上限				无			
最小申购、赎回单位(单位:份)				XXXX份			
是否需要公布IOPV				是			
	申购赎回的允	许情况		申购和赎回皆允许			
		T日成	战份股信息内容				
证券代码	证券简称	股票数量(股)	现金替代 标志	现金替代 溢比价率	替代金額 (単位:人民币元)		
	购的情形	1		1	1		

1.因不可抗力等效基金方法正常运作。
2.发生基金合同规定的特殊基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请;当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出版之可参考的活版市场价格且采用估值技术仍导效公允价值存在重大不确定性时,然与基金代管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值,并暂停接受投资。内印申申申明。
3.正券利用该交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人定計计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。
4.基金管理人可根据市场情况在申购版回清单中设置申购份额上限,或率率的申购申请被确认成功,会使本基金当申购份额证时,可根据市场情况在申购版回清单中设置申购份额上限,或率申购申请被查记。
6.基金管理人可根据市场情况在申购版回清单中设置申购份额上限,或率申购申请被查记他。
6.基金资产规模过大,使基金管理人无法投资合适的投资品种,或证券市场价格发生大幅波动,或其他可能对基金业燃产生负部等利人抵债等取利基金份额特有人指益的销形。
7.基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单编则结对

8、因相关证券交易所、中购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购,或者因指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回活单无法编制或编制不当。上述异常情况相基金管理人无法预见并不可控制

、本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五人,由此产生的收益或损失由基金财产 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。 週特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中

5.%亚盲1.7日天内各 见金替代是指申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的-定数量的现金。 现金替代分为4种类型;禁止现金替代(标志为"禁止"),可以现金替代(标志为"允许")和必须观金替代 (标志为"必须")和退补现金替代(标志为"退补")。 禁止现金替代通用于上海证券交易所上市的成份证券,是指在中购、赎回基金份额时,该成份证券不允许使用 现金化为基件。

理人格追赴多收取1722年18, 收取欠集的差型。 3) 替代金额的处理程序如下; TFI,基金管理人在申粵縣回清单中公布现金替代溢价比例,并揭此收取替代金额。 在TFI与接替代的部分证券有正常交易的2个交易目(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买 在TFI与接替代的部分证券有正常交易的2个交易目(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买

(双) 4)替代限制:为有效控制基金的限踪偏离度和限踪误差,基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为; ∑第4页目代证券数量×价证券卷卷价格

公式中,"该证券参考价格"的确定原则与可以现金替代情况下,替代金额的计算公式中的该证券参考价格确定原则相同。基金份额参考净值目前为60下前一交易日路权策息后的收盘价、如果上海证券交易所基金份额参考净值付海。 (2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(2)关于必须现金替代。(3)发生 (2)天士必观规金替代 1)适用情形:必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除的成份证券;或处于停牌的成份证券;或 律法规限调投资的成份证券;或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人认为有必要实行必须现金替代的

3)替代金额的处理照序 对指导现金替代而言,申明时收取现金替代溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人将买人该证 身,实际买人价格加上相关交易费用后与该证券调整后下日开盘参考价可能有所差异。为便于操作。基金管理人在 中期限的海中市场先确定现金替代溢价比例,并提此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购人该部分证 净的实际成本,则基金管理人将退还多收取的差额。如果预先收取的金额底于基金购人该部分证券的实际成本,则

图表:T日申购赎回清单的格式举例如下:

基金管理公司名称				汇添富基金管理股份有限公司			
一级市场基金代码				XXXXXX			
		Т-	- 1日信息	内容			
现金差額(单位:元)				xx.xx元			
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元)				ххххπ			
基金份额净值(单位:元)				x.xxxx元			
			r日信息F	内容			
最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位:元)				хх.хх元			
现金替代比例上限				XX%			
申购上限				无			
赎回上限				无			
最小申购、赎回单位(单位:份)				XXXX份			
是否需要公布IOPV				是			
申购赎回的允许情况				申购和赎回皆允许			
		TH	成份股信	息内容			
证券代码	证券简称	股票数量(股)		金替代 示志	现金替代 溢比价率	替代金額 (単位:人民币元)	
					1		

管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下。安排专门的中顺方式,开于新的中顺方式并始执行前另行公告。
2. 在不违反法律法规且对持氧合份制持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人口以根据具体情况开心基本基金的场外中胸腺间等业务。场外中胸腺间的具体办理方式等相关平项届时常另行公告。
3. ETF联接基金是指其他大部分基金财产投资于跟您间一标的指数的ETF、紧密跟踪标约指数表现,追求跟踪储据度和跟踪差量小化。采用开放式运作于克的基金。若本基金抽任的正序接基金。ETF联接基金可以在本基金基金合同性效后,开放日常中购之前用股票或现金经除中脚本基金基金合领,不收取中购费用。
4. 基金管型人可以在不五些支法律法规规定且对基金分额持有人无实质性不利影响的前提下,调整基金中则赎回方式或中购赎回对价组成,并提前公告。
5. 在条件允许时,基金管规人并提前公告。
9. 账户间在成员整数据,进行中购。
条件允许时,在全量大量不可以在全量大量不可以在一个工程,是全量工程的工程,并是全量工程的工程,并是一个工程,是全量工程的工程,并是一个工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程的工程,是全量工程,是全量工程,是全量工程,是全量工程,是全量工程,是一个工程,是全量工程,是全量工程,是一个工程,是全量工程,是全量工程,是一个一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,是一个工程,

6、基金管理人指定的代理が1799910、1793年384 二、投资剂制 本基金主要投资于标约制数成份股、各选成份股、 为里车地实现投资目标。本基金可少量投资于活的价股(包括中山板、创业板及其他中国证监会核准上市的股 界),债券(包括团债、金融债、企业低、公司债、订交纳债券、可转换债券、分额之易可转债、中小企业私募债 券、决行票据、中期票据、短期融资券(合越短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币 市场工具、衍生工员(包括股捐财货、权证、国债财货、股票期权等)及法律法规处中国证监会允许基金投资的其他 金融工具(但或符合中国证监会的样关规定)。 金融工具(但或符合中国证监会的样关规定)。 在条件许可的情况下,基金管理人可任不改变本基金版有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的的 提下、根据用法法律法规。等金融被及转换通证券出售业务,以提高投资效率及进行风险管理。

或延缓支付赎回对价。 3、证券/期货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或无法进行证券交易 4、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单、基金份额净值或者IOPV计算错误,申购赎回清单单

即用原。 5、因相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回,或者因指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回前单无法编制或编制不当。上述异常情况相基金管理人无法都贝并不可控制

等形,包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。 6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申

动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为程序后,可以将其纳入投资范围。 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,因法律法规的规定而受限制 出,时形成了。 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。

数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和眼 的指数时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的 ie 桂砕梅况有纸但不阻于门下椿形。(1) 注律注抑的阻制。(2) 标的提数成份股溶动性 亚重不见。(3) 标的提数 等然同意包括自己中級学式人自用学工工资中企业的现象的工人资的资源或成功效的处理。 的成份股票长用停停课(4)是它合理原因等效本基金管理人对标的指数的服装的级产量的影响。 未就金力争自均跟影响原证的政党信不超过02%,年限影谈差不超过2%。如场标识指数部的第一次 原因,等效基金融影响原设和服装设美超过上途范围,基金管理人及平成合理措施,维克跟摩伽高度和服装设差的

期於。依证、國德則簽、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或础置专见用7%定少7.1。
2. 值券投资策略
2. 值券投资策略
法金管型人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的
影响,进行合理的利率预期,则断债券市场的基本走势,制定公用控制下的资产类属危置策略。在债券投资组合物
基本管理过程中,基金管理与从移具体采用即服然构和置,抗药垫粮。信用未是和租对价值判断,信用风险间等估、通 金管理等管理手段进行个券选等。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流力性的基础上,降低限定证差。 全管理等管理手段进行个券选等。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流力性的基础上,降低限定证差。 本基金将在严格控制信用股险的基础上,通过严密的投资决策就是从变接权审批记期,集中交易制度等保险 审辖投资于中小企业私募债券,对其投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的的 据下、重点选择资度较好,收益率较好的中小企业私募债券扩行投资。 3. 资产支持证券投资策较大,依益率较好的中小企业私募债券扩行投资。
3. 资产支持证券投资的产的质量和构成、利率风险、信用风险、 流进生风险和提前偿付风险等进行分析,评估其相对投资价值并作出相比的投资决策。
4. 金融衍生工具投资策略

1、资产性监理师 本基金管则人完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其 值的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股份体系还并基金资产净值的90%,股指 发 权证。随他的说,规则和及其他金融工具的变法也像的压法律法规或值管制的形规定从

4.金融行生工具投资策略 本基金将基于谨慎原则运用股指期货、权证、国债期货、股票期权等相关金融行生工具对基金投资组合进行管理,以控制计降低投资组合风险、提高投资效率、降低融额误差、从而更好地实现本基金的投资目标。 未基金投资股捐削货将帐规风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股捐期货合约、以降低交易成本、提高投资效率,从而更少地跟踪标的指数。 发生金将通过对权证标的证券的基本面进行研究、结合多种定价模型和投资策略、根据基金资产组合情况适度进行和证的组资。

(组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制; (1)本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%; (2)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%; (3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过被权证的 10%; (4)本基金产于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过金资产净值的0.5%; (5)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,不得超过金资产净值的10%; (6)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%; (7)本基金持有的宣和资产支持证券,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 (8)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 /枫的10%; 本基金应检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

(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上信告BB的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下海、不再符合投资标准,放在评级报告发布之品必为用分为让全部变出;
(10)基金对产参与股票股分目中级,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和发产股股公司本次发行股票的总量;
(11)本基金进入全国银行间间业市场进行债券回购的贸金率条额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间间业市场进行债券回购的明后不展期;
(12)本基金特和的单尺中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(13)本基金等是指销货和国础销货公息,应当编写于项型实;
13)本基金等是指销货和国础销货公息,应当编写于项型实;
13)本基金等是指销货和国金销货公息,应当编写于项型实;

30%;
(a)本基金每个交易日日终在扣除国佛明货和股捐明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后的现金,其中现金不包括结算备付金,存出保证金,应收申购款等。(4)因未平仓的股票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%;开仓卖出从场股股票期权的,放持有短额标的证券;并仓卖出从站股票期权的,应持有创新行股所需的全额建金成交易所规则认可的可补抵即权保证金的现金等价物;未平仓的股票期权合约而值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权的股票以合约乘数以合约乘数计算;基金投资股票期权合约而值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权风险收益特征; a+f=u:; 本基金参与融资的,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

(15)本基金金与融资的、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%;
(16)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95%。证券出借的平均剩余即服不得超过30天。平均剩余即报照市值加取平均计算,
(17)本基金主动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,上市公司股票停阱、基金规模变动等基金管理人之外的风事效使基金投资比例不符合上述投资比例限制的,基金管理人不得可的情况的使是假致产的投资、法律法规另有规定的,从其规定;
(18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会投资的银生体为交易对手方开展逆回购交易的,可接受质用品的资度求收当与基金合同约定的投资范围保护一致;
(19)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(20)法律法规及中国证监会规定的报。基金管则多约定的其他投资限制。除上述(9)、(7)、(18)项外、民证券/明货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、给的指数成份股流地限期等基金管理人之外的因素数使基金份批价不符合上还规定投资比例的。基金管理人应当在10个交易日均进行调整。但中国证据全规定的特殊情形能外。法律法规户有规定的从其实是全合同生效之日起不分用户健基合的投资的上处则有发产的内容之分定。上述期间内、本基金的投资信息从完当基金合同生效之日起不分用,但是由时间不会上继续的发展,是可能会的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金任管人对基金的投资的监督与检查目基金合同生效之日起开始,是有关限制证及等是全合同生效之日报开始,是有关限制证依证的是有关限制定按定更后的规定投行。

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;

如法律法规或监管部门取消上迷禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。 五、业绩比较基准 本基金业绩比较基准为标的指数收益率,即中证800指数收益率。 中距800指数由中证指数有限公司按布,如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或上述 标的指数由其他相数替代。由由于指数编制方法的重大变更等事项导致上述指数不宜继续作为标的指数、或证券 市场有其他代表性更强。更适合投资的指数推出,基金管理人认为有必要作相应调整时、本基金管理人可以依据维 等投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中考验 的指数涉及本基金投资泡腾或投资策略的实质性变更,则基金管理人总验变更标的指数召开基金份额持有人大 ※必必及平基並投資范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人反於変更拆的指数召开基金份额持有人与 样與中国证监会备案且在指定媒介公告、若变更原的指数对基金投资范畴和投资策略无变质性影响(包括自 指数编制单位变更 指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商— 法P中国证监会备案并及时公告。 六、风险收益特征

六、风险收益特征 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。 第十二部分 基金的财产 一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成 产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

他基金财产账户相独立。 四、基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金 扩管人、基金影记制和减基金销售机构以其自有的财产派担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使 请求冻结,扣押或其他权利。除依法律法规和(基金合同)的规定处分外,基金财产不得被处分。 基金管理人、基金托管人因依法解放、被依法精迫或者被依法直告破产等原因进行清冀的、基金财产不展于其 清冀财产。基金管理人有理位作基金财产所产生的债权、不得与其固有资产生的债务和互抵的基金管理人管理 运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。 第十三部分 基金资产估值 一、佔值日 本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证,采用估值技术确定公允10°1回,在10°1回以不胜以可用的国面的情况下,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价值。对于活跃市场损价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整。确认计量日的公允价值,对于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价值。
(4) 渐进受限的股票(包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,通过大宗交易取得的市银银即股票等(不包括停除,新发行未上市、回购交易中的财产等流通受限股票),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合权的固定收益品种、按照第二方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。
"经验证证本标》中令知构调市收益系统,按照第二方估值机构提供的相应品种当日的唯一价值。 3.对全国银行间市场上不各权的固定收益品种。按照第三方值值例构提供的相应品种当日的估值净价估值。 纳银行间市场上各权的固定收益品种。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金推合值净价 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券偿即所对应的 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 在明型差异,未上市期间市场利率没有发生大价变动的情况下,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.中小企业私募债券来用估值接未商定公允价值。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

」 。 7、本基金投资股指期货合约,一般以股指期货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

的情形,包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

9.法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

29.法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

这当性有关规定在指定域人上对验暂停中购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者申购申请时,基金管理人 应当根据有关规定在指定域人上对验暂停中购购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购对价格退还给投资人。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。

九.暂停晚回或旋熄交付线回对价的情况
发生下列情形时,基金管理人可管停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价:
1.因不可抗力导致基金管理人不管要或办理基金份额持有人的赎回申请。

2次生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价:当前一位信目基金资产净值60%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格呈来用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,然与基金社管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值,并暂停接受投资人的赎回申请或延缓变付赎回对价。

济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结鹑价估值。
8.本基金投资股票期权合约,一般以股票期权当日结鹑价进行估值,估值当日无结鹑价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结鹑价价值。
9.本基金投资国债期货合约,是以国债期货合约估值目的结鹑价估值。估值当日无结鹑价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结鹑价估值。如法律法操今后另有规定的,从其规定。10.如何南侧进报表明投上达方法进行信值不能客取废映其么允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金打造人商定后,按规能反映公允价值的价格估值。如法律法规令人成为证明,按图家最新规定估值,11.相关。在未进未以及股份营密门有调制股份,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。11.相关。在未进未以及股份营密门有调制股份,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。11.相关。在未进未以及股份营密门有调制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值,在成本经济的企业,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值,和基金管理人或基金任务企份的有关,和超时,放立的国现对方,共同管理规则,或为的解释、根据有关法律法规,基金资产净值计算机基金资计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计数量的义务由基金管理人承担。本基金自然的实计问题,或处据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。四,估值程序

际凹區在27 基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001

、10至2010年1月1日在EXFATURE 1上1F14011月,第2021 「中国年少二十基立日前印苏德双軍日界,們們到U0001 「教政長高第60回會五人、国家另有规定的,从其规定。 基金管理人每个工作日计屬基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。 2. 基金管理人每个工作日对基金资产的值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除 基金管理人每个工作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, 全營理人基础等对核公系

请。

7. 基金管理人可根据市场情况在申喫赎回清单中设置赎回份额上限,如果一笔新的赎回申请被确认成功,会 使本基金当日赎回份额超过申喫赎回消单中规定的赎回份额上限时,该笔赎回申请将被拒绝。
8.法律张良,治师华孝安易所规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述第1.2.3 4.5.6.8项情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回的付明,基金管理人应在网站及更性城外上刊整新公公、在新台车还被的保持。 1.估值错误类型 基基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人,或登记机构,或销售机构、或投资人自身的过错造成 推销域,导致其他当年人都受损失的,进销的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人("受损方")的直接 法板下选"估值错误处理规则"给予解偿,承担赔偿责任。 上述估值错误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 、哲停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 发生上述哲停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒介

没暂停公告。 2.基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放日在指定 刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时 以行没布重新开放的公告。 整辯等。 2. 佔值错误处理原则 (1) 佔值错误已发生。但尚未給当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正 直错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成 块的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方之经极协调,并且有协助义务的当事人 起够的评词进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况间有关当事人进 确认,确保估值错误已得到理工 行[双伯迪斯开放的公古。 ---基金价额的转让 法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或 方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人权受理基金份额转让业务 遗前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

吴调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

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

误处理。 2.由于证券/明货交易所/指数编制机构及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力等原因,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,由此违政的基金资产估 值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成污染啊。

一、基金利润的粉成 基金利润的粉成 基金利润的基金利息收入、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 指基金利润和减去公允价值变动收益后的余额。 二、基金可任分配利润有概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、基金收益分配规则 1.每一基金份额享利司等分配权; 2.本基金的收益分配采用现金分配; 3.本基金的收益分配采用现金分配; 3.本基金的收益分配采用现金分配; 3.本基金的收益分配采用现金分配; 基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前捷,收益分配后有可能健除息后的基金份额净值低于面值。

5. 法律法规或监管机头分有规定的,从其规定。 在不违反法律法规具以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原则 进行调整,无需召开基金份额持有人大会。 四、或益分配方案 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

、57配/7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

基金线1利及及口匙190%加入15-2000 六、基金收益分配中发生的费用 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。 第十五部分 基金费用与税收

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。

7. 发起19. 2003。 松基金将充分考虑国债期货流动性和风险收益特征,在风险可挖的基础上,以套期保值为目的,参与国债期货 本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标,比例限制,风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

> 基金管理券包计算。遂目累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5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、公休日等 支付日期順延。 2.基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一F · -日基金资产净值的0.07%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

3、基金的指数许可使用费

算。 如果指数使用许可协议的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识指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书更新成其他公告中政旗本基金最新适 用的标的指数件可使用费使等。具体计算方法及支付方式。 上述"一基金费用的种类"中第4-11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,用基金代替人从基金财产中支付。

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。 第十六部分 基金的会计与审计

界十六部分 基室的宏口 与甲口 一、基金会计政策 、基金管理人为本基金的基金会计责任方; 、基金管公公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则;如果《基金合同》 2.基金的系计平度/AS/D平度(5)17月12年27月1日;基金目0 少于2个月,可以并入下一个会计年度披露; 3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位; 4、会计制度执行国家有关会计制度;

《采计司级风灯》间87年7天张7,1910年, 永基金给亚里米,独立楼海; ,基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金 ₹表; · 基全杆管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。二、基金的年度 甲口 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师 对本基金的年度财务报表讲行审计。

ョアがでは、 第十七部分 基金的信息披露 - 本基金的信息披露の符合《基金法》、《伝作か法》、《信息披露か法》、《基金合同》及其他有关規定。 二、信息投騰义务人 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法 中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。 本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确

性和完整性。 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。 三、本基金信息披露义务人或诸公开按照的基金信息,不得有下列行为: 1.虚假记载,误导性陈述或者重大遗漏; 2.对证券投资业绩进行预测;

公开披露的基金信息包括:
(一)基金招募访明书。《基金合同》、基金托曾协议
1、《基金合同》是外定《基金合同》、当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,该明基金产品的特性等涉及基金投资者重人利益的事项的法律文件。
2.基金招募访明书的空制是人限您地按据的事场。
全投资、基金产品特性、风险揭示、信息按照及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每个月结束之日起36日内,更新招募边明书并整数作基场收入。将更新后的招募边明书排更级个上线查管理人在每个月结束之日起36日内,更新招募边明书排更级个上线更新后的招募边明书排更级个上线查管理人在66个16日前的主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容

(二) 基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定 :)《基金合同》生效公告 验智用人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。 1)基金份额上市交易公告书 並份额政准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前,将基金份额上市

介上。
如报告期内出现单一投资者特有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管
理人至少应当在定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类别,报告期末持有份额及占 比。报告期时持有份额变化情况及本基金的特有风险。
《基金合同》注效不足2个月的,基金管理从可以不编制当期季度报告,半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开按照的第2个工作日、分别报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 活出机场备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 (九)临时报告

(下转A24版)

外。基金官理人思了上下日本第二 由基金管理人按规定对外公布。 五、估值错误的处理 基金管理人和基金柱管 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4位以内含第4位发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 基金合同的当事人应按照以下约定处理:

行輸站、總保信值错误已得到更正。 (2)估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对向接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。 (3)因估值错误而获得小当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负负责。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追成其他当事人的利益损失,"受损方"),则估值错误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形分不当得利返还给受损方,则受损力应当将其已经获得的职价。

(4) 估值错误调整采用是量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。
3.估值错误观发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的段和下;
估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的段型。
(1) 查明估值错误处于即原因,列明所有的当事人,并根据估值错误处生的原因确定估值错误的责任方;
(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错当造成的损失进行评估;
(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误的责任方进行更正和赔偿损失,
(4) 根据估值错误处理形方法,需要修定基金登记机构变易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误 正应有关当事人进行确认。
4.基金份额净值估值错误处理的方法如下;
(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进一步扩大。

(2) 曾議與屬差达到基金份額净值的0.5%時,基金管理人应当通稅基金托管人并报中国证監会备案;错误編差 达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告。 (3) 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。 、大等停住的的特形。 1.基金投资所涉及的证券利朋贫少易市场通法定节假日或因其他原因暂停营业时; 2.因不可打力效使基金管理人,基金托管人无法准确评估基金资产价值时; (3. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的近跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性,并终与基金社管人为编码认后,基金管理人应当暂停估值时; 4.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

4、不可可证以不必要证 日间外足引突已间分。 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 管理人场于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额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按规定予以公布。 、特殊情形的处理 基金管理人按本部分第三条有关估值方法规定的第10项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值管

第十四部分 基金的收益与分配

但; 4、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配; 5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

基金的和数许可使用数; 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费; 基金份领辖有人 5全费用;

10. 基金四银行工划费用: 1. 按周国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 二. 基金费用计划方法, 计划标准和支付方式 1. 基金管理人的管理费 本基金的管理费转前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=EX 0.15% + 当年天教 日本区以往规划注入6%回14%。

是公司的。 基金托管发每日计算。避日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指 基金托管人复核后于次月前6个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期能

。用基金托官人从基金财产中支付。 三、邓列人基金费用: 1、基金管理人和基金先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; 4、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; 4、基金信息中生效的的相关等。 1、基本化性规相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的项目。 2、基金合同)对于

对产量室的中度财务很表进行审计。 2.会计师事务所更焕绘办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。 3.基金管理人认为有法思理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

四、承基金公升投降时归尽起水归于人人个。 一级。两种文本发生接及仍以中文文本为明 本基金公开披露的信息采用间拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。 公开披露的基金信息。 公开披露的基金信息包括:

可同说时。 、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系 印法年入叶。 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘 要登载在指定媒介上;基金管理人,基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

(九)施訊报告 本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报 证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件: 1.基金份额持有人大会的召开;

1. 基金价额持有人大会的召开;
2. 签上(基金合同);
3. 转绝基金运作方式;
4. 更晚基金管理人,基金托管人);
5. 基金管理人及东及其出郊比两处生变更;
6. 基金管理人及东及其出郊比两处生变更;
6. 基金管理人及东及其出郊比两处生变更;
7. 基金券票现长。
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员,基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
9. 基金管理人的董事任一年内变更超过百分之五十。
10. 基金管理人为基金件一年内变更超过百分之五十。
11. 涉及基金管理业务,是金财产、基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
11. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管部门的实业价。
12. 基金管理人及重量,总经则是其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚,

、赎回基金份额时参考。 1、基金份额参考净值的计算公式。

式办理基金的份额申购和赎回。 基金管理人在开始申购,赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单,并可根据情况变更或增减基金申购赎回 理券商,并可以公告。 二、申购和赎回的开放日及时间