嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)招募说明书

(上接24版)

净认购金额＝认购金额/(1＋认购费率);

认购费用＝认购金额－净认购金额;

认购份额＝(净认购金额＋认购利息)/基金份额面值。

场外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。认购款项在募集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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位,小数点后两位以后部分截去,由此产生的误差计入基金财产。

例一:某投资者投资10,000元认购本基金,所对应的认购费率为1.0%,如果其认购资金的利息为5.30元,则其可得到的基金份数计算如下:

净认购金额＝10,000/(1+1.0%)＝9,900.99元

认购费用＝10,000 － 9,900.99＝99.01元

认购份数＝(9,900.99＋5.30)/1.00＝9,906.29份

即投资者投资10,000元认购本基金,在基金合同生效时,投资者账户登记有本基金9906.29份基金份额。

3、投资人对基金份额的场外认购

(1)认购时间安排

投资者可在募集期内前往本基金销售机构的网点办理基金份额认购手续,具体的业务办理时间详见本基金的发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(2)投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(3)认购的方式及确认

1)本基金认购采取全额缴款认购的方式,投资者认购前,需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

2)基金募集期内,投资者可多次认购基金份额,但已申请的认购不允许撤销。

3)投资者在T日规定时间内提交的认购申请,通常可在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4)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。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

5)若投资者的认购申请被确认为无效,基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

(4)认购的限额

1)在募集期内,投资者可多次认购,对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限。

2)认购最低限额:在基金募集期内,投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次认购单笔最低限额为人民币5,000元,追加认购单笔最低限额为人民币1,000元;投资者通过直销中心柜台首次认购单笔最低限额为人民币20,000元,追加认购单笔最低限额为人民币1,000元。

(八)基金份额的场内认购

本节内容仅适用于基金份额的场内认购,通过此种方式认购后基金份额登记在证券登记结算系统中。

1、募集场所

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位(具体名单详见发售公告或相关业务公告)进行。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格,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上市交易。

2、基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

(1)本基金份额初始发售面值为人民币1.00元,挂牌价格为初始发售面值。

(2)本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取。基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

(3)场内会员单位应按照场外认购费率设定投资者场内认购的认购费用。

(4)场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为:

净认购金额＝挂牌价格×认购份额

认购费用＝挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额＝净认购金额＋认购费用

利息折算的份额＝利息/挂牌价格

场内认购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。认购款项在募集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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位(最小单位为1份),余额计入基金财产。

例如:某投资者认购本基金10,000份,若会员单位设定发售(认购)费率为1.0%,假定该笔认购产生利息5.00元。则认购金额和利息折算的份额为:

挂牌价格＝1.00元

净认购金额＝挂牌价格×认购份额＝1.00×10,000＝10,000元

认购费用＝挂牌价格×认购份额×认购费率＝1.00×10,000×1.0%＝100元

认购金额＝净认购金额＋认购费用＝10,000＋100＝10,100元

利息折算的份额＝利息/挂牌价格＝5.00/1.00＝5份

即:投资者认购10,000份基金份额,需缴纳10,100元,若利息折算的份额为5份,则总共可得到10,005份基金份额。

3、投资人对基金份额的场内认购

(1)认购时间安排

投资者可在募集期内前往具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单见发售公告)办理基金份额的场内认购手续,具体的业务办理时间详见本基金的发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(2)投资者认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

(3)认购的方式及确认

1) 投资者认购前, 需按办理场内认购业务相关机构规定的方式备足认购的金额。

2)基金募集期内,投资者可多次认购基金份额,但已申请的认购不允许撤销。

3)投资者在T日规定时间内提交的认购申请,通常应在T+2日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4)办理场内认购业务相关机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表办理场内认购业务相关机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

(4)认购的限额

场内认购单笔最低认购份额为1000份,超过1000份的须为1000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购份额不设限制。

(九)募集资金的存放

《基金合同》生效前,投资者的认购款项只能存入商业银行,不得动用。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件

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2亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理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日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,基金合同生效;否则基金合同不生效。

基金合同生效时,认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有。

(二)基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果基金合同不能生效,基金管理人应当承担下列责任:

1)以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2)在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本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5,000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

八、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。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;登记在基金注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中,再进行上市交易。

(一)上市交易的地点

深圳证券交易所。

(二)上市交易的时间

本基金合同生效后三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。

(三)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《业务规则》的相关规定。

(四)上市交易的费用

本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

(五)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。

(六)上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

发生下列情形之一时,本基金应暂停上市:

(1)基金份额持有人数连续20个工作日低于1000人;

(2)基金总份额连续20个工作日低于2亿份;

(3)违反国家法律、行政法规,中国证监会决定暂停本基金上市;

(4)深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时,基金管理人在接到深圳证券交易所通知后,应立即在至少一种指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

暂停上市情形消除后,基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请;经深圳证券交易所核准后,可恢复本基金上市。

(七)终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时,本基金应终止上市交易:

(1)自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;

(2)基金合同终止;

(3)基金份额持有人大会决定终止上市;

(4)深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时,由证券交易所终止其上市交易,基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市,并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

九、基金份额的申购、赎回

本基金份额的申购与赎回包括场内申购赎回、场外申购赎回两种方式。

(一)申购、赎回的场所

1. 基金份额的场外申购与赎回场所

(1)本基金管理人的直销中心柜台;

(2)中国工商银行的指定网点以及基金管理人指定的其他代销机构营业网点;

(3) 本基金管理人的基金网上交易系统(具体业务规则与说明参见相关公告)。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所,并予以公告。

2. 基金份额的场内申购与赎回场所

深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位(具体名单见本基金相关业务公告)。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构,并予以公告。

(二)申购、赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前2日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站(以下简称"网站")公告。

申购和赎回的开放日为本基金公开办理申购、赎回业务后,上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日(基金管理人公告暂停申购或赎回时除外),投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。对于场外申购与赎回,具体业务办理时间以销售机构公布时间为准;对于场内申购与赎回,具体业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购、赎回时间进行调整,但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

(三)申购与赎回的帐户

1. 场外申购与赎回的帐户

投资者通过场外申购、赎回应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(账户开立的具体事项参见本基金发售公告认购开户相关内容)。

2. 场内申购与赎回的帐户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户(账户开立的具体事项参见本基金发售公告认购开户相关内容)。

(四)申购与赎回的原则

1. "未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2. "金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请。同时,场内申购和赎回申报单位应遵循深圳证券交易所的规定为准;

3. 赎回遵循"先进先出"原则,即按照认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4. 当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;当日的场内申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销;

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

(五)申购与赎回的程序

1. 场外申购与赎回的程序

(1)场外申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序,在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

(2)场外申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请,正常情况下,基金管理人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在T+2日后(包括该日)投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

(3)场外申购和赎回的款项支付

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账户。

投资者T日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T＋7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

2. 场内申购与赎回的程序

办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,将按新规定执行。

(1)场内申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时,其账户内必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

(2)场内申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请,正常情况下,基金管理人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在T＋2日后(包括该日)投资者应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

业务办理单位对申购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表业务办理单位确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

(3)场内申购和赎回的款项支付

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账户。

投资者T日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T＋7日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

(六)申购与赎回的数额限制

1. 申请申购基金的金额限制

投资者通过代销机构、嘉实基金管理有限公司网上直销或场内业务办理单位首次申购单笔最低限额为人民币5,000元;投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元;但已认购本基金的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币1,000元,追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购,对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2. 申请赎回基金的份额限制

单笔赎回不得少于1,000份,如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足1000份,则必须一次性赎回基金全部份额;若某笔赎回或转换转出业务导致投资者在销售机构托管的基金余额不足1000份时,该笔赎回或转换转出业务应包括账户内全部基金份额,否则基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

(七)申购费用和赎回费用

1. 申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%,具体如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M＜100万元	1.2%
100万元≤M＜200万元	0.8%
200万元≤M＜500万元	0.4%
M≥500万元	单笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2. 赎回费用

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。

本基金的场外赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低。具体如下:

持有期限	赎回费率
＜365天	0.50%
365天≤M＜730天	0.25%
≥730天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付市场推广、销售、注册登记费等相关费用。

3. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和降低赎回费率。费率如发生变更,基金管理人应在调整实施2日前在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

4. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的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,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(八)申购份额与赎回金额的计算

1. 场外申购份额与赎回金额的计算

(1)场外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)

申购费用＝申购金额—净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日基金份额净值

例如,某投资者投资5,000元申购本基金,对应费率为1.2%,假设申购当日基金份额净值为1.128元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额＝5,000/(1+1.2%)＝4,940.71元

申购费用＝5,000－4,940.71＝59.29元

申购份数＝4,940.71/1.128＝4,380.06份

即:某投资者投资5,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.128元,则可得到4,380.06份基金份额。

(2)场外基金赎回金额的计算:

采用"份额赎回"方式,赎回金额以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

例如:假定三笔赎回申请的赎回份额均为10,000份,但持有时间长短不同,其中基金份额净值为假设数,那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(份,A)	10,000	10,000	10,000
基金份额净值(元,B)	1.100	1.300	1.400
持有时间	100天	366天	731天
适用赎回费率(C)	0.5%	0.25%	0%
赎回总额(元,D=A×B)	11,000	13,000	14,000
赎回费(E=C×D)	55	32.5	0
赎回金额(F=D-E)	10,945	12,967.5	14,000

(3)场外申购份额、余额的处理方式:

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2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。

(4)场外赎回金额的处理方式:

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用来计算,赎回金额计算结果保留到小数点后2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。

2. 场内申购份额与赎回金额的计算

(1)场内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)

申购费用＝申购金额—净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日基金份额净值

申购份额计算结果保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例如:某投资者通过场内投资10,000元申购本基金,对应的申购费率为1.2%,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额＝10,000/(1＋1.2%)＝9,881.42元

申购手续费＝10,000－9,881.42＝118.58元

申购份额＝9,881.42/1.025＝9,640.41份

因场内申购份额保留至整数份,故投资者申购所得份额为9,640份,整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为:

实际净申购金额＝9,640×1.025＝9,881.00元

退款金额＝10,000－9,881.00－118.58＝0.42元

即:投资者投资10,000元从场内申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.025元,则其可得到基金份额9,640份,退款0.42元。

(2)场内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

赎回金额计算结果保留到小数点后2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。

场内赎回适用固定赎回费率,与份额持有期限无关。

例如:某投资者从场内赎回本基金10,000份基金份额,赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则其可得净赎回金额为:

赎回总金额＝10,000×1.148＝11,480元

赎回费用＝11,480×0.5%＝57.40元

净赎回金额＝11,480－57.40＝11,422.60元

即:投资者从深圳证券交易所场内赎回本基金10,000份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为1.148元,则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

3. 基金份额净值计算

T日基金份额净值＝T日基金资产净值/T日发行在外的基金份额总数。

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。基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数,基金份额净值单位为元,计算结果保留在小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。由此产生的误差在基金财产中列支。

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。

(九)申购和赎回的注册登记

1. 场外申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者登记权益并办理注册登记手续,投资者自T+2日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后,基金注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资者的合法权益,并最迟于开始实施前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

2. 场内申购和赎回的注册登记

本基金场内申购和赎回的注册登记业务,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(十)拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形,基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请:

1. 不可抗力的原因导致基金无法正常运作;

2. 证券交易场所在交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算;

3. 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,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益;

4. 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形;

5. 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的,被拒绝的申购款项将全额退还给投资者。发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。

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,并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

(十一)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形,基金管理人不得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款项:

1. 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项;

2. 证券交易场所依法决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

3. 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续2个或2个以上开放日巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;

4. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请,基金管理人将足额支付;如暂时不能足额支付的,可延期支付部分赎回款项,按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时,在出现上述第(3)款的情形时,对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项,最长不超过20个工作日,并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资者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。

暂停基金的赎回,基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

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,并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

(十二)巨额赎回的情形及处理方式

1. 巨额赎回的认定

本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本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投资者的全部赎回申请时,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投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请,应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外,延迟至下一个开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(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日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站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。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。

本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;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,并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

(十三)重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天,基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

(十四)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

(十五)基金转换

为方便基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

十、基金的基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入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;场内认购、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。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转登记。

(一)系统内转托管

1. 系统内转托管是指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. 基金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,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3. 基金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或场内赎回的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

(二)跨系统转登记

1. 跨系统转登记是指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登记的行为。

2. 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

十一、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业务,并收取一定的手续费用。

十二、基金的投资

(一)投资目标

本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。

(二)标的指数

本基金标的指数为中证锐联基本面50指数。

如果中证锐联基本面50指数被停止编制及发布,或中证锐联基本面50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中证锐联基本面50指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上出现其他更适合投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数和投资对象;并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

(三)投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如果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,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%;权证市值不超过基金资产净值的3%;现金及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本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

(四)投资理念

从长期来看,中国经济将保持持续增长态势,为资本市场的良好发展奠定了坚实的基础。指数化投资可以为投资者提供分享中国经济增长和资本市场发展成果的好工具。

标的指数为基本面加权指数,具备基本面优良、流动性高、大盘蓝筹等特性。本基金通过指数复制法,有效跟踪标的指数,力争为投资者带来较好的长期投资回报。

(五)投资策略

本基金采取完全指数复制法,即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权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。在跟踪误差允许的情况下,本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的固定收益类证券投资范围包括国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、短期融资券、回购(包括正回购和逆回购)、资产支持证券等。

如果未来法律法规或监管机构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。

本基金投资将遵照:

(一)、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定。

(二)、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作,基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

(三)、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

1. 研究:指数投资研究人员依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作,作

为基金投资决策的重要依据。

2. 投资决策:投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告,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,每日进行基金投资管理的日常决策。

3. 组合构建:基金经理根据标的指数相关信息,结合内部指数投资研究,以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的投资方法,以降低投资成本、控制投资风险。

4. 交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

5. 投资绩效评估:投资流程与风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

6. 组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,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以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

(六)股票组合的构建与调整方法

本基金采用完全指数复制法,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权重的变动进行相应调整。在发生以下情况时,基金管理人将对资产组合进行适当变通和调整,使跟踪误差控制在限定的范围内:

1、因受成份股股票停牌限制、股票流动性等其他市场因素的影响或因受法律法规、基金合同等合规因素限制,使基金管理人无法依据指数购买某成份股;

2、预期标的指数的成份股发生新增、剔除或成份股发生配股、增发、分红等行为,或因公司行为导致指数权重发生变化;

3、其他可能影响指数复制的因素,如基金分红、大额申购或赎回等。

(七)投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,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,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(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;

(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,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,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;

(2) 本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,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%,本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例,遵从法规或监管部门的相关规定;

(3) 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%;

(4)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%; 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%;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%;

(5) 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%;

(6)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;

(7)本基金持有的债券其信用级别不低于BBB级;

(8)法律法规和基金合同规定的其他限制。

《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。

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约定。因证券市场波动、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规定的,基金管理人应在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

(八)业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

95%×中证锐联基本面50指数收益率＋5%×银行同业存款收益率

中证锐联基本面50指数以基本面指标来衡量上市公司的经济规模,选取其中最大的50

家A股上市公司作为样本,且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数综合反映了中国证券市场基本面良好企业的整体状况,适合作为本基金的标的指数。

如果相关法律法规发生变化,或中证锐联基本面50指数被停止编制及发布,或中证锐联基本面50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中证锐联基本面50指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,与基金托管人协商一致并履行相关程序后,变更本基金的标的指数,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

(九)风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

(十)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 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;

2. 有利于基金资产的安全与增值;

3. 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。

4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。

(十一)基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

十三、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的价值总和。

其构成主要有:

1. 银行存款及其应计利息;
2. 清算备付金及其应计利息;
3. 根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息;
4. 应收证券交易清算款;
5. 应收申购款;
6. 股票投资及其估值调整;
7. 债券投资及其估值调整和应计利息;
8. 权证投资及其估值调整;
9. 其他投资及其估值调整;
10. 其他资产等。

(二)基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三)基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务,并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并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金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)基金财产的保管及处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产;基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或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、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承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。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵消;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消。

十四、基金资产估值

(一)估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值,依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值,是计算基金申购与赎回价格的基础。

(二)估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

(三)估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

(四)估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人,基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人;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)估值方法

本基金按以下方式进行估值:

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市价(收盘价)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)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市价(收盘价)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、因持有股票而享有的配股权,从配股除权日起到配股确认日止,如果收盘价高于配股价,按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

4、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。

5、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。

6、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。

7、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。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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。

(六)、基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时,基金管理人应当立即纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;当估值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,并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的,应先由基金管理人承担,基金管理人对不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

关于差错处理,本合同的当事人按照以下约定处理:

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、或代理销售机构、或投资者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"给予赔偿承担赔偿责任。

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无法预见、无法避免、无法抗拒,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者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承担;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) 差错的责任方对可能导致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资产损失时,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资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿。

(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、行政法规、《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的交易数据的,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;

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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并报中国证监会备案。

(七)暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;

3、中国证监会认定的其他情形

(八)特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,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,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金收益与分配

(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为10次,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%,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,对于场外认购、申购的基金份额,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;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额;

场内认购、申购和上市交易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,具体权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;

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日内在指定媒体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,基金注册登记机构有权将基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

十六、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、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;

(7)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(8)基金的银行汇划费用;

(9)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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.0%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前2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0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.18%÷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款指令,基金托管人复核后于次月前2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,支付日期顺延。

(3)基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用,不列入基金费用;基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支,按前一日基金资产净值及指数许可使用费年费率每日计提,逐日累计。计算方法如下:

H＝E×I÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

I为基金管理人与本基金的标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费年费率。

根据指数使用许可协议,标的指数许可方收取的指数许可使用费年费率设定如下:

收费条件	指数许可使用费年费率
本基金合同生效后的前两个公历年度	0.09%
成立的第三个年度起,当: 前一季度日均资产净值≥40亿元	0.09%
成立的第三个年度起,当: 前一季度日均资产净值＜40亿元	0.12%

基金管理人与指数许可方约定了每季指数许可使用费人民币拾伍万元(15万元)的收取下限,则该下限超出当季累计指数使用费的部分(即:每季指数许可使用费收取下限减当季累计指数许可使用费)由基金管理人自行承担,不作为基金费用从基金财产中列支。

基金合同生效后的指数许可使用费按季支付,由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令,基金托管人复核后于次季前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述1、基金费用的种类中第(4)－(8)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、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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(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。

4、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经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前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二)与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第六部分第(七)、(八)条的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本招募说明书第九部分第(五)条、第(七)条、第(八)条的相关规定。

(三)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。

十七、基金的会计与审计

(一)基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;

2、基金的会计年度为公历年度的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》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度;

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;

5、本基金独立建账、独立核算;

6、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会计报表;

7、基金托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)基金的年度审计

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进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

3、基金管理人认为有充足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日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

十八、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

(二)信息披露义务人

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规和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的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露,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承诺公开披露的基金信息,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;

3、违规承诺收益或者承担损失;

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

6、中国证监会禁止的其他行为。

(四)本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

(五)公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后,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》摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上;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网站上。

(1)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露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6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上;基金管理人在公告的15日前向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,并就有关更新内容提供书面说明。

(2)《基金合同》是界定《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,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 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、义务关系的法律文件。

2、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媒体和基金管理人网站上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后,在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基金份额净值。在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,披露开放日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、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内, 编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人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披露的第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派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

7、临时报告

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中国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;

(2)终止《基金合同》;

(3)转换基金运作方式;

(4)更换基金管理人、基金托管人;

(5)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

(6)基金管理人股东及其出资比例发生变更;

(7)基金募集期延长;

(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)基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;

(10)基金管理人、基金托管人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)涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

(12)基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

(13)基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、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;

(14)重大关联交易事项;

(15)基金收益分配事项;

(16)管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

(17)基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

(18)基金改聘会计师事务所;

(19)变更基金销售机构;

(20)更换基金注册登记机构;

(21)本基金开始办理申购、赎回;

(22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

(23)本基金发生巨额赎回并延期支付;

(24)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

(25)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

(26)中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

10、中国证监会规定的其他信息。

(六)信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒体披露信息,但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

(下转26版)