深证成份交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

南方基金管理有限公司

公告日期:二〇一〇年一月二十八日

一、重要声明与提示

《深证成份交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称"本公告")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")管理人南方基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2009年11月5日《中国证券报》及南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)上公告的《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称:深成ETF
2、二级市场交易代码:159903
3、基金申购赎回简称:深成ETF
4、申购赎回代码:159903
5、标的指数简称:深证成指
6、标的指数代码:399001
7、2010年1月26日基金份额总额:3,045,554,507份
8、2010年1月26日基金份额净值:1.218元
9、本次上市交易份额:3,045,554,507份
10、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
11、上市交易日期:2010年2月2日
12、基金管理人:南方基金管理有限公司
13、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

14、申购赎回代理券商:华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司。

(1)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025-84457777-950、248
联系人:李金龙
客户咨询电话:025-84457777-950
网址:www.htsc.com.cn

(2)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:胡长生
联系人:李洋
电话:010-66568047
客户服务电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(3)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-177
传真:021-62583439
客户服务热线:4008888666
联系人:芮敏祺
网址:www.gtja.com

(4)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:400-8888-001、021-95553
公司网址:www.htsec.com

(5)中信建投证券有限责任公司
法定代表人:张佑君
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
联系人:魏明
开放式基金咨询电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(6)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦9楼
法人代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务联系人:齐晓燕
联系电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
全国统一客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(7)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:潘锴
电话:0431-85096709
客户服务电话:4006000686 0431-85096733
网址:www.nesc.cn

(8)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
联系人:傅咏梅
电话:0531-81283728
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2009年10月13日证监许可[2009]1066号。

2、基金合同生效日:2009年12月4日。

3、基金运作方式:交易型开放式。

4、基金合同期限:不定期。

5、发售日期:2009年11月9日至2009年11月27日。其中,网下现金发售和网上现金发售的日期为2009年11月9日至2009年11月27日,网下股票发售的日期为2009年11月23日至2009年11月27日。

6、发售价格:人民币1.00元。

7、发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构:

(1)网下现金发售机构
南方基金管理有限公司

(2)网上现金发售代理机构

本基金网上现金认购业务通过以下具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理(排序不分先后):国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、联合证券、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、信泰证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所开放式基金销售系统办理本基金的认购业务。

(3)网下股票发售代理机构

华泰证券、银河证券、兴业证券、广发证券、联合证券、国泰君安、中信证券、海通证券、中信建投、申银万国、东莞证券、国信证券、招商证券、长城证券、湘财证券、金通证券、渤海证券、南京证券、国联证券、光大证券、东北证券、广州证券、国都证券、齐鲁证券、中信万通、山西证券、长江证券、第一创业、中原证券、中银国际、东吴证券、平安证券、国海证券、中投证券、江南证券、德邦证券、西南证券、方正证券、国盛证券、华安证券、大同证券、华林证券、新时代证券、上海证券、民生证券、东方证券、宏源证券、安信证券、东海证券、西部证券、恒泰证券、万联证券、国元证券、金元证券、浙商证券、银泰证券、华鑫证券、世纪证券、华宝证券、华龙证券、国金证券、江海证券、信达证券、华融证券(排序不分先后)。

9、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况

深证成份交易型开放式指数证券投资基金于2009年11月9日起公开募集,基金募集工作已于2009年11月27日顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集的募集金额总额为4,127,252,482.00元人民币(含所募集股票市值),有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计303,329.68元人民币,按照本基金基金合同、招募说明书的约定,其中286,055.00元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有;其余17,274.68元为利息折份额计算尾差归入基金资产。募集资金已于2009年12月3日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户,募集股票已于2009年12月3日由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为42,054户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算,募集期募集金额(含所募集股票市值)及利息结转的基金份额共计4,127,538,537.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理有限公司基金从业人员没有认购本基金。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2009年12月4日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(二)基金份额折算

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,南方基金管理有限公司(下简称"本基金管理人")确定2010年1月13日为深证成份交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为13016.557点,本基金资产净值为3,964,290,323.04元,折算前基金份额总额为4,127,538,537.00份,折算前基金份额净值为0.960元。

根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为0.73786718,折算后基金份额总额为3,045,554,507份,折算后基金份额净值为1.302元。

本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由中国证券登记结算有限责任公司于2010年1月15日完成了变更登记。折算后的基金份额计算至整数位(小数部分舍去,舍去部分计入基金财产)。

(三)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上【2010】38号
2、上市交易日期:2010年2月2日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、基金二级市场交易简称:深成ETF
5、二级市场交易代码:159903
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易
6、本次上市交易份额:3,045,554,507份
7、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2010年1月26日,本基金份额持有人户数为42,036户,平均每户持有的基金份额为72,451份。

(二)持有人结构

截至2010年1月26日,本基金份额持有人结构如下:

机构投资者持有的基金份额为784,984,868份,占基金总份额的25.7748%;个人投资者持有的基金份额为2,260,569,639份,占基金总份额的74.2252%。

(三)截至2010年1月26日,前十名基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例(%)
1	海通证券股份有限公司	118,075,986	3.88
2	齐鲁证券有限公司	110,684,872	3.63
3	王巧英	73,797,785	2.42
4	广发证券股份有限公司	51,652,252	1.70
5	东北证券股份有限公司	37,147,080	1.22
6	国信证券股份有限公司	36,904,428	1.21
7	中信建投证券有限责任公司	36,897,673	1.21
8	长城证券有限责任公司	36,896,002	1.21
9	华泰证券股份有限公司	36,895,702	1.21
10	招商证券股份有限公司	25,826,126	0.85

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

名称:南方基金管理有限公司
法定代表人:吴万善
总经理:高良玉
注册资本:1.5亿元人民币
注册地址:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]4号
工商登记注册的法人营业执照文号:440301103129537
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例:华泰证券股份有限公司45%、深圳市机场(集团)有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

3、内部组织结构及职能

委员会名称	职责
投资决策委员会	指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则
风险控制委员会	研究制定风险管理政策和制度,提出重大风险的解决方案,指导和监督各职能部门开展风险管理工作
部门名称	职能定位
投资部	负责公募股票类基金产品的投资管理
研究部	负责宏观策略、行业与上市公司研究
专户投资管理部	负责年金、社保及专户产品的权益类资产的投资管理
固定收益部	负责固定收益类基金产品及资产的投资管理
国际业务部	负责国际基金的投资管理与业务合作
风控策略部	负责投资策略的量化测算、数量化投资、投资风险监控与业绩归因分析
养老金业务部	负责企业年金基金的市场开拓与服务
机构业务部	负责机构直销及一对一专户产品的业务拓展及服务工作
专户管理部	负责一对多专户产品的业务拓展及服务工作
产品开发部	负责产品开发、设计、报批及产品管理工作
策略发展部	负责品牌推广、产品推广、营销策划、媒体宣传、公共关系维护
渠道服务部	负责对各营销中心的监督管理及代销渠道总部的维护、渠道经理的培训等
东部营销中心	负责所在区域公募基金、一对多专户等产品的销售工作及区域内代销渠道机构的维护和服务
南部营销中心	
西部营销中心	
北部营销中心	
电子商务部	负责基金产品的网上销售及公司网站建设
市场服务部	为基金持有人提供专业服务及投资理财资讯服务
合肥分公司	CALL-CENTER客户营销及服务中心
监察稽核部	负责合规及运作风险的全面管理
交易管理部	负责执行基金、组合交易指令,实施一线风险监控
信息技术部	负责信息技术平台建设,保障业务开展
运作保障部	负责投资交易与产品销售的后台清算、核算及投资运作的定期信息披露
人力资源部	负责人力资源管理与服务,使公司获取并保持人力资源竞争优势
综合管理部	负责办公管理、财务管理、后勤保障
党群工作部	负责党务及共青团、工会工作
基建办	负责公司办公大楼的基建工作
北京分公司	作为公司在北京地区的业务窗口
上海分公司	作为公司在上海地区的业务窗口

4、人员情况

截止到2009年12月,本公司共有员工305人,博士14人、硕士143人、本科136人、其他12人。

5、信息披露负责人:鲍文革
咨询电话:400-889-8899

6、基金管理业务情况

截至2009年12月,南方基金管理有限公司旗下共管理19只开放式基金和2只封闭式基金及多只社保投资组合和企业年金投资组合,管理总资产规模超过1830多亿元人民币,旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南方多利、南稳贰号、南方绩优、南方隆元、南方成份、南方价值、南方盛元、南方恒元、南方300、南方500、深成ETF、南方深成和南方全球;封闭式基金有基金开元和基金天元;以及多个全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

7、本基金基金经理简介

潘海宁先生,1977年出生,会计学学士,9年基金从业经历,具有基金从业资格。曾任职于富国基金管理有限公司,2003年加入南方基金管理有限公司,先后担任行业研究员、基金开元经理助理、投资部总监助理等职务,2009年3月至今,担任南方沪深300指数基金基金经理;现兼任深成ETF及其联接基金基金经理。

(二)基金托管人

1、基金托管人概况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系电话:010-66105799
联系人:蒋松云

2、主要人员情况

截至2009年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工123人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终坚持"诚实信用、勤勉尽责"的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2009年9月,托管证券投资基金131只,其中封闭式8只,开放式123只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初,中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为2008年度"中国最佳托管银行",自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得18项国内外大奖。

(三)验资机构

普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:薛竞、单峰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金2010年1月26日资产负债表如下:

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产:		负债:	
银行存款	1,604,649.37	短期借款	
结算备付金	24,766,146.55	交易性金融负债	
存出保证金	4,186,540.98	衍生金融负债	
交易性金融资产	3,682,624,289.03	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	3,682,624,289.03	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,432,233.46
基金投资		应付托管费	286,446.71
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	3,434,190.16
应收证券清算款	2,329,681.61	应付税费	
应收利息	727,380.11	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	169,693.06
其他资产		负债合计	5,322,563.39
		所有者权益:	
		实收基金	4,127,538,537
		未分配利润	-416,622,412.74
		所有者权益合计	3,710,916,124.26
资产合计:	3,716,238,687.65	负债与持有人权益总计:	3,716,238,687.65

附注:本基金发行在外的基金份额为3,045,554,507份,基金份额净值为1.218。

八、基金投资组合

截止到2010年1月26日,本基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

项目名称	项目市值	占基金资产总值比重
股票	3,682,624,289.03	99.10%
债券	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	26,370,795.92	0.71%
其他资产	7,243,602.70	0.19%
资产总值	3,716,238,687.65	100.00%

(二)按行业分类的股票投资组合

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	251,623,408.35	6.78%
C 制造业	1,901,653,443.26	51.24%
C0 食品、饮料	443,040,602.28	11.94%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	100,067,262.00	2.70%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	538,711,686.84	14.52%
C7 机械、设备、仪表	612,648,776.01	16.51%
C8 医药、生物制品	207,185,116.13	5.58%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	32,846,987.91	0.89%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	33,476,923.08	0.90%
G 信息技术业	223,615,244.82	6.03%
H 批发和零售贸易	204,069,782.70	5.50%
I 金融、保险业	469,964,382.39	12.66%
J 房地产业	480,914,897.72	12.96%
K 社会服务业	84,459,218.80	2.28%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
	0.00	0.00%
	0.00	0.00%
合计	3,682,624,289.03	99.24%

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	市值占净值比
000002	万科A	36,116,079	332,990,248.38	8.9733%
000001	深发展A	11,616,064	256,134,211.20	6.9022%
000858	五粮液	7,491,756	221,606,142.48	5.9717%
002024	苏宁电器	11,299,545	204,069,782.70	5.4992%
000063	中兴通讯	3,806,583	166,956,730.38	4.4991%
000983	西山煤电	4,967,149	152,541,145.79	4.1106%
000651	格力电器	5,697,993	136,523,912.28	3.6790%
000623	吉林敖东	2,199,513	114,946,549.38	3.0975%
000568	泸州老窖	2,903,046	104,654,808.30	2.8202%
000792	盐湖钾肥	1,755,566	100,067,262.00	2.6966%

(四)按券种分类的债券投资组合

截至2010年1月26日,本基金未持有债券。

(五)按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2010年1月26日,本基金未持有债券。

(六)投资组合报告附注

(1)根据2009年2月26日青海盐湖钾肥股份有限公司(下称:盐湖钾肥,股票代码:000792)《青海盐湖钾肥股份有限公司受到有关部门相关处罚的提示性公告》,由于青海盐湖钾肥股份有限公司销售部门在2008年部分销售期间,未及时严格履行监管部门制订的氯化钾销售临时指导价格(公司氯化钾售价超出指导价),监管部门对公司2008年进行了500万元的相关经济处罚。

根据2009年9月9日宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)《宜宾五粮液股份有限公司第四届董事会公告》,中国证券监督管理委员会决定根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,就五粮液涉嫌违反证券法律法规对该公司进行立案调查。目前该案尚在调查之中。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,基金管理人对上述两只股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

其余八只股票的发行主体没有报告期内被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产:

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	4,186,540.98
2	应收证券清算款	2,329,681.61
3	应收利息	727,380.11
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合计		7,243,602.70

(4)本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2010年1月26日,本基金未持有可转换债券。

(5)按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

截至2010年1月26日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

2010年1月13日,本基金进行了基金份额折算,具体情况详见本公告书"基金份额折算"部分。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;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,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金份额申购、赎回

(一)申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构,并予以公告。

目前,本基金申购赎回代理券商的名单如下:华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司。若深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购赎回的,本基金管理人将另行公告。

(二)申购与赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

自2010年2月2日起,本基金开始办理申购、赎回。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日(基金管理人公告暂停申购或赎回时除外),开放时间为深圳证券交易所的交易时间。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。

若深圳证券交易所变更交易时间或实际情况需要,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前3个工作日在至少一家指定媒体公告。

(三)申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况,在不损害基金份额持有人权益、不违背交易所相关规则的情况下可更改上述原则。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公告并报中国证监会备案。

(四)申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续,在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时,须根据申购、赎回清单备足申购对价。投资者提交赎回申请时,必须持有足够的基金份额余额和现金,否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所的结算规则。

投资者T日申购、赎回成功后,登记结算机构在T日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算,在T+1日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算,在T+2日办理现金差额的交收,并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形,则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内,对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整,并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(五)申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位为30万份,基金管理人有权对其进行调整,并在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(六)申购、赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时,基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、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0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告,计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

(七)申购、赎回清单的内容与格式

1、申购、赎回清单的内容

T日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

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

现金替代是指申购、赎回过程中,投资者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一定数量的现金。

采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率,基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则,以保护基金份额持有人利益为出发点,并进行及时充分的信息披露。

(1)现金替代分为3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")和必须现金替代(标志为"必须")。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时,允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代,但在赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时,该成份证券必须使用现金作为替代。

(2)可以现金替代

①适用情形:可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。

②替代金额:对于可以现金替代的证券,替代金额的计算公式为:

替代金额=替代证券数量×该证券经除权调整的T-1日收盘价×(1+现金替代保证金率)

对于使用现金替代的证券,基金管理人需在证券恢复交易后买入,而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作,基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率,并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将退还多收取的差额;如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

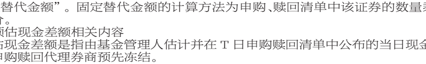
③替代金额的处理程序

T日,基金管理人在申购、赎回清单中公布现金替代保证金率,并据此收取替代金额。在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2日日终,若已购入全部被替代的证券,则以替代金额与被替代证券的实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项;若未能购入全部被替代的证券,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况:若自T日起,深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+2日后第1个工作日(若在特例情况下,则为T日起第21个交易日),基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给登记结算机构,登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算;T+2日后第2个工作日(若在特例情况下,则为T日起第22个交易日),登记结算机构办理现金替代多退少补资金的交收。

④替代限制:为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,基金管理人可规定投资者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:



说明:假设当天可以现金替代的股票只数为n。

(3)必须现金替代

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,或基金管理人出于保护持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购、赎回清单中公告替代的一定数量的现金,即"固定替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购、赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的T-1日收盘价。

4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为:

T日预估现金差额=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和)

其中,T日经除权调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。另外,若T日为基金分红除息日,则计算公式中的"T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值"需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购、赎回清单中公告,其计算公式为:

T日现金差额=T日最小申购、赎回单位的基金资产净值-(申购、赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购、赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和)。

T日投资者申购、赎回基金份额时,需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时,如现金差额为正数,则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金,如现金差额为负数,则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金;在投资者赎回时,如现金差额为正数,则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为负数,则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6.申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下:

基本信息
最新公告日期:2009-1-27
基金名称:深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称:南方基金管理有限公司
基金代码:159903
标的指数代码:399001

T-1日信息内容
现金差额(单位:元)0
最小申购赎回单位资产净值(单位:元)365540.93
基金份额净值(单位:元)1.218

T日信息内容
预估现金差额(单位:元)717.93
最小申购赎回单位(单位:份)300,000
T日最小申购赎回单位分红金额(单位:元)0.0
是否需要公布IOPV 是
是否允许申购 否
是否允许赎回 否
可以现金替代比例上限 25%

成份股信息内容

股票代码	股票名称	股票数量	现金替代标志	可以现金替代保证金率	固定替代金额
000001	深发展A	1100	允许	21.0%	
000002	万科A	3600	允许	21.0%	
000024	招商地产	300	允许	21.0%	
000027	深圳能源	200	允许	21.0%	
000039	中集集团	400	允许	21.0%	
000060	中金岭南	300	允许	21.0%	
000063	中兴通讯	400	允许	21.0%	
000069	华侨城A	600	允许	21.0%	
000157	中联重科	300	允许	21.0%	
000338	潍柴动力	200	允许	21.0%	
000402	金融街	800	允许	21.0%	
000527	美的电器	500	允许	21.0%	
000538	云南白药	100	允许	21.0%	
000562	宏源证券	200	允许	21.0%	
000568	泸州老窖	300	允许	21.0%	
000623	吉林敖东	200	允许	21.0%	
000630	铜陵有色	300	允许	21.0%	
000651	格力电器	600	允许	21.0%	
000652	泰达股份	400	允许	21.0%	
000709	河北钢铁	1700	允许	21.0%	
000729	燕京啤酒	200	允许	21.0%	
000768	西飞国际	400	允许	21.0%	
000783	长江证券	500	允许	21.0%	
000792	盐湖钾肥	200	允许	21.0%	
000800	一汽轿车	400	允许	21.0%	
000825	太钢不锈	900	允许	21.0%	
000839	中信国安	400	允许	21.0%	
000858	五粮液	800	允许	21.0%	
000878	云南铜业	300	允许	21.0%	
000895	双汇发展	100	允许	21.0%	
000898	鞍钢股份	500	允许	21.0%	
000932	华菱钢铁	400	允许	21.0%	
000933	神火股份	100	允许	21.0%	
000937	冀中能源	100	允许	21.0%	
000960	锡业股份	100	允许	21.0%	
000983	西山煤电	500	允许	21.0%	
002007	华兰生物	100	允许	21.0%	
002024	苏宁电器	1100	允许	21.0%	
002142	宁波银行	400	允许	21.0%	
002202	金风科技	200	允许	21.0%	

(八)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)深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购;
(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形;
(5)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;
(6)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,基金管理人应当在当日报中国证监会备案。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予以公告。

(九)暂停赎回的情形及处理方式

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:
(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)深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理赎回;
(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形;
(5)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

暂停基金的赎回,基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回公告。

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公告。

(十)其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项,但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的,可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

(九)集合申购与其他服务

在条件允许时,基金管理人可开放集合申购,即允许多个投资者集合其持有的组合证券,共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍,进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务,双方需签订书面委托代理协议,并报中国证监会备案。

(十)基金的转托管和非交易过户等其他业务

登记结算机构可依据其业务规则,受理基金份额的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务,并收取一定的手续费用。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会核准基金募集的文件
(二)《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

南方基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十八日

附件:基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额,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金的基金份额。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)依法转让或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;
(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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)遵守《基金合同》;
(2)缴纳基金认购、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
(3)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
(4)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
(5)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及销售机构处获得的不当得利;
(6)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)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、委托、更换基金销售机构,对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结算机构,办理基金登记结算业务,获得《基金合同》规定的费用,并从登记结算机构获取基金份额持有人名册;
(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)在符合有关法律法规、交易所及登记结算结构相关业务规则和《基金合同》的前提下,制订和调整本基金业务规则,决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;
(13)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;
(14)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;
(15)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;
(16)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;
(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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;如认为销售机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议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;
(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、赎回的清单;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制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、足额支付赎回对价;
(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;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;
(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,发售代理机构将已冻结的股票解冻;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(26)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收入;
(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)以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;
(5)以基金托管人名义开立证券交易资金账户,用于证券交易资金清算;
(6)以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;
(7)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(8)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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名册登记、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对价;
(15)按照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自行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。

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本基金的基金份额持有人或其合法授权代表以及联接基金的基金份额持有人或其合法授权代表共同组成。

联接基金的基金份额持有人或其合法授权代表参加本基金的基金份额持有人大会时,其参会份额和票数按权益登记日联接基金所持有的本基金基金份额占联接基金资产的比例折算。折算为本基金后的每一基金份额和本基金的每一基金份额拥有平等的投票权。

(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》;
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人;
(4)转换基金运作方式;
(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
(6)变更基金类别;
(7)本基金与其他基金的合并;
(8)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
(9)终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外;
(10)变更基金份额持有人大会程序;
(11)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(12)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
(13)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会变更基金合同等其他事项;
(14)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:
(1)调低基金管理费、基金托管费;
(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;
(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式,或调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
(4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
(5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
(6)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(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,应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提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;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。

5、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(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40天,在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
(1)会议召开的时间、地点、方式和会议形式;
(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决形式;
(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。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定通讯方式和表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的效力。

(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召开。

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托委派代表出席,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利登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%(含50%)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人约定的非现场方式形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以召集人约定的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

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

(2)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表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的,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%);

(4)上述第(3)项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定;

(5)会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者;表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(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。

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日30天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

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

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

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

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

2、议事程序

(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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(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》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,符合会议通知规定的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拒不出席大会的,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对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(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日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

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。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一)基金收益分配原则

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》;

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;

3、在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益分配每年最多12次,每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

4、本基金收益分配采取现金分红方式;

5、《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

6、每一基金份额享有同等分配权;

7、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(二)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(三)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后确定,基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。

(四)基金收益分配中发生的费用

红利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。

四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(一)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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷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。

(二)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。

(三)与基金销售相关的费用,其计提方法、计提标准和支付方式详见《基金的募集》、《基金份额的申购和赎回》章节。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(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,本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。待指数衍生金融产品(如股指期货等)推出以后,基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。

(三)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)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

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

(3)本基金投资于股指期货等金融衍生工具的有关比例限制将遵循届时有效的规定执行;

(4)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

(5)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的,基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《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。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

(一)《基金合同》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过:
(1)终止《基金合同》;
(2)更换基金管理人;
(3)更换基金托管人;
(4)转换基金运作方式;
(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
(6)变更基金类别;
(7)本基金与其他基金的合并;
(8)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
(9)终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外;
(10)变更基金份额持有人大会程序;
(11)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会变更基金合同等其他事项;
(12)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。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案:
(1)调低基金管理费、基金托管费;
(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;
(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更收费方式,或调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
(4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
(5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
(6)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,自《基金合同》变更生效之日起在至少一家指定媒体公告。

(二)《基金合同》的终止

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:
1、基金份额持有人大会决定终止的;
2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
3、《基金合同》约定的其他情形;
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(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》终止后,由基金财产清算小组统一接管基金;
(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
(3)对基金财产进行估值和变现;
(4)制作清算报告;
(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
(6)将清算报告报中国证监会备案并公告。
(7)对基金财产进行分配;

5、基金财产清算的期限为6个月。

八、争议解决方式

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、申购赎回代理券商的办公场所和营业场所查阅;投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件,但内容应以《基金合同》正本为准。