

易方达沪深**300** 交易型开放式指数发起式证  
券投资基金上市交易公告书暨开放日常申  
购赎回公告

易方达基金管理有限公司

二〇一三年三月二十日

# 目录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览 .....	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介.....	7
六、基金合同摘要 .....	13
七、基金财务状况 .....	13
八、基金投资组合 .....	15
九、重大事件揭示 .....	19
十、基金管理人承诺 .....	19
十一、基金托管人承诺 .....	19
十二、基金上市推荐人意见.....	20
十三、基金份额的申购与赎回.....	20
十四、备查文件目录 .....	37
附件：基金合同摘要 .....	38

## 一、重要声明与提示

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《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〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的董事会及董事保证本报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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海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。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定信息披露媒体和易方达基金管理有限公司网站（www.efunds.com.cn）上的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：HS300ETF。
- 2、二级市场交易代码：510310。
- 3、基金申购、赎回简称：沪深申赎。
- 4、申购、赎回代码：510311。
- 5、2013 年 3 月 18 日基金份额总额：1,104,307,415 份。
- 6、2013 年 3 月 18 日基金份额净值：0.9973 元。
- 7、本次上市交易份额：1,104,307,415 份。
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 9、上市交易日期：2013 年 3 月 25 日。
- 10、基金管理人：易方达基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
- 12、上市推荐人：申银万国证券股份有限公司。
- 13、目前，本基金的申购、赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）如下：广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，我司将另行公告。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金上市前基金募集情况

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2012年12月31日中国证监会证监许可[2012]1762号文。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、基金合同期限：不定期。
- 4、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三种方式。
- 5、发售日期：本基金自2013年2月18日至2013年2月28日进行发售。其中，网下现金认购的日期为2013年2月18日至2013年2月28日，网上现金认购和网下股票认购的日期为2013年2月26日至2013年2月28日。
- 6、发售价格：1.00元人民币。
- 7、发售期限：网下现金发售9个工作日，网上现金发售和网下股票发售3个工作日。
- 8、发售机构

##### (1) 直销机构

投资者可通过基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。

##### (2) 代销机构

本基金网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为：广发证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

本基金的网上现金发售代理机构：具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

#### (二) 基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2012]1762号文批准，自2013年2月18日起向全社会公开募集，截至2013年2月28日，募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为1,104,263,810元人民币（含募集股票市值），有效净认购金额产生的利息共计43,605元人民币。本次募集所有资金已于2013年3月6日划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为7,051户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算。设立募集期间募集的有效份额为1,104,263,810份基金份额；利息结转的基金份额为43,605份基金份额。两项合计共1,104,307,415份基金份额，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本公司及本公司基金从业人员没有认购本基金。

本基金于2013年3月6日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于2013年3月6日正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担。

### （三）基金上市交易

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所上证基字[2013]87号。
- 2、上市交易日期：2013年3月25日。
- 3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 4、基金二级市场交易简称：HS300ETF。
- 5、二级市场交易代码：510310。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

- 6、基金申购、赎回简称：沪深申赎。
- 7、申购、赎回代码：510311。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前，本基金的一级交易商包括广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，我司将另行公告。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

- 8、本次上市交易份额：1,104,307,415份。
- 9、未上市交易份额的流通规定：

本基金包括场内份额与场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额。

在本基金开始办理场外申购赎回业务之后，本基金除场内份额外还将增加一类场外份

额。条件许可情况下，本基金场外份额既可在不同场外的销售机构之间办理系统内转托管，也可跨系统转托管为场内份额，但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

本基金场内份额可直接在上海证券交易所上市交易，场外份额应由基金份额持有人通过申请办理跨系统转托管将基金份额转为场内份额后，方可进行场内赎回和上市交易。场外申赎及跨系统转托管的具体业务规定和规则另行公告。

## 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 2013 年 3 月 18 日，本基金份额持有人户数为 7,051 户，平均每户持有的基金份额为 156,617.13 份。

### （二）持有人结构

截至 2013 年 3 月 18 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 719,401,724 份，占基金总份额的 65.15%；个人投资者持有的基金份额为 384,905,691 份，占基金总份额的 34.85%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况：

截至 2013 年 3 月 18 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	易方达基金公司—交行—易方达—交通银行优选 1 号资产管理计划	111,565,617	10.10
2	佛山市美的投资管理有限公司	100,000,000	9.06
3	全国社保基金四零二组合	52,869,600	4.79
4	易方达基金公司—交行—广发证券股份有限公司	49,985,997	4.53
5	易方达基金公司—交行—平安证券有限责任公司	49,985,997	4.53
6	易方达基金公司—交行—招商证券股份有限公司	49,985,997	4.53
7	易方达基金公司—交行—申银万国证券股份有限公司	49,985,997	4.53
8	中信证券股份有限公司	40,000,000	3.62

9	中国银河证券股份有限公司	36,000,000	3.26
10	中信建投证券股份有限公司	33,766,304	3.06

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

1. 名称：易方达基金管理有限公司

2. 法定代表人：叶俊英

3. 总裁：刘晓艳

4. 注册资本：壹亿贰仟万元人民币

5. 注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室

6. 设立批准文号：证监基金字[2001]4号

7. 工商登记注册的法人营业执照文号：440000000002868

8. 经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务。

9. 股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份 25%；广发证券股份有限公司，持有股份 25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份 25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份 16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份 8.33%。

10. 内部组织结构及职能：

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设二十五个部门：基金投资部、机构理财部、固定收益总部、指数与量化投资部、研究部、投资发展部、集中交易室、投资风险管理部、养老金部、市场部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、南京分公司、机构客户部、系统研发部、技术运营部、核算部、注册登记部、宣传策划部、综合管理部、人力资源部、监察部、北京代表处。

各部门的主要职责概述如下：

基金投资部负责公募基金资产的日常管理和运作。

机构理财部负责社保基金、企业年金和其他受托资产的投资管理工作。

固定收益总部负责公司管理的固定收益资产的投资、研究及交易工作。

指数与量化投资部主要负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。

研究部的主要工作职责是对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种进行研究。

投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发；为市场营销工作提供专业支持。

集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作，保存交易记录，备份交易数据。

投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估，负责投资研究系统建设相关的工作，以及与投资研究跨部门流程相关的支持性工作。

养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。

市场部主要负责公司市场营销和销售支持工作，为渠道、机构客户、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持，研究和开发设计基金行业电子商务模式等。

宣传策划部负责制作宣传材料，传播公司信息，管理媒体关系，管理广告投放及维护公司网站等。

北京分公司负责组织实施以北京为中心的华北和西北地区的销售工作。

上海分公司负责组织实施以上海为中心的华东地区及西南、东北部分地区的销售工作。

广州分公司负责组织实施以广州为中心的华南地区的销售工作。

成都分公司负责组织实施以四川省为中心的销售工作。

南京分公司负责组织以江苏省为中心的销售工作。

机构客户部负责公司机构客户的销售和服务工作。

系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。

技术运营部负责公司 IT 基础设施的规划与建设，公司日常运营的技术支持与服务，保障公司信息系统安全可靠高效运行。

核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作，负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作，以及各银行账户的管理工作。

注册登记部主要工作是进行开放式基金和特定多个客户资产管理计划的注册登记业务。

综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作，负责公司财务会计、行政保卫和文书档案等工作。

人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施，具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

监察部独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督，协助并督促各部门履行内控职责，确保公司各项经营活动稳健合规，实现公司经营目标。

北京代表处负责与在京监管部门的日常联系工作。

#### 11. 人员情况

截止到 2013 年 2 月 28 日，本公司有员工 392 人，其中 220 人具有硕士学历，22 人具有博士学历。93%的公司员工具有基金从业资格。

#### 12. 信息披露负责人：张南

电话：020-85102688

### 13. 基金管理业务介绍

截至 2013 年 2 月 28 日，本公司旗下共管理 40 只开放式基金和 1 只封闭式基金，公募基金资产管理规模 1896.83 亿元。旗下管理的封闭式基金有科瑞证券投资基金。开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深 300 指数证券投资基金、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金、易方达量化衍伸股票型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金。

### 14、本基金基金经理

林飞先生，经济学博士。曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司指数与量化投资部总经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理和易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理，兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

林伟斌先生，经济学博士。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理。

## （二）基金托管人情况

### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 9 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”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，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

## （三）上市推荐人

申银万国证券

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

联系电话：021-54033888

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

#### （四）一级交易商

##### （1）广发证券

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：020-87555305

网址：www.gf.com.cn

##### （2）东方证券

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

传真：021-63326173

网址：www.dfzq.com.cn

##### （3）光大证券

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务电话：400-8888-788、10108998

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(4) 华安证券

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

联系电话：0551-5161666

客户服务电话：96518、400-80-96518

开放式基金业务传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com

(5) 平安证券

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

(6) 申银万国证券

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

联系电话：021-54033888

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

(7) 银河证券

注册地址：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：陈有安

联系人：田薇

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(8) 中信建投证券

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(五) 基金验资机构

会计师事务所：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 1318 号星展银行大厦 6 楼

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：沈兆杰

经办会计师：薛竞、庄贤

## 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

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

(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

本基金截至 2013 年 3 月 18 日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
资 产：	
银行存款	885, 171, 230. 54
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	216, 397, 790. 65
其中：股票投资	215, 801, 790. 65
债券投资	596, 000. 00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	13, 909. 84
应收利息	28, 608. 73
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	146, 654. 69
资产总计	1, 101, 758, 194. 45
负债和所有者权益	
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-

应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	181,892.01
应付托管费	36,378.39
应付销售服务费	-
应付交易费用	142,399.69
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	25,850.14
负债合计	386,520.23
所有者权益：	
实收基金	1,104,307,415.00
未分配利润	-2,935,740.78
所有者权益合计	1,101,371,674.22
负债和所有者权益总计	1,101,758,194.45

## 八、基金投资组合

截至 2013 年 3 月 18 日，本基金的投资组合情况如下：

### (一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	215,801,790.65	19.59
	其中：股票	215,801,790.65	19.59
2	固定收益投资	596,000.00	0.05
	其中：债券	596,000.00	0.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	885,171,230.54	80.34
6	其他各项资产	189,173.26	0.02
	合计	1,101,758,194.45	100.00

## (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,044,549.56	0.09
B	采掘业	19,468,207.45	1.77
C	制造业	74,512,355.50	6.77
C0	食品、饮料	12,676,248.73	1.15
C1	纺织、服装、皮毛	521,923.93	0.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,683,139.74	0.43
C5	电子	6,373,419.54	0.58
C6	金属、非金属	14,340,191.72	1.30
C7	机械、设备、仪表	21,064,671.76	1.91
C8	医药、生物制品	14,558,187.50	1.32
C99	其他制造业	294,572.58	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,061,553.00	0.55
E	建筑业	6,911,400.68	0.63
F	交通运输、仓储业	6,171,569.60	0.56
G	信息技术业	5,250,220.89	0.48
H	批发和零售贸易	4,255,019.08	0.39
I	金融、保险业	73,573,876.94	6.68
J	房地产业	13,216,298.60	1.20

K	社会服务业	1,911,128.00	0.17
L	传播与文化产业	994,429.35	0.09
M	综合类	2,431,182.00	0.22
	合计	215,801,790.65	19.59

**(三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	917,200	9,217,860.00	0.84
2	600036	招商银行	643,540	8,031,379.20	0.73
3	601166	兴业银行	309,900	5,733,150.00	0.52
4	601318	中国平安	136,400	5,541,932.00	0.50
5	600000	浦发银行	455,100	4,769,448.00	0.43
6	000002	万科A	393,724	4,208,909.56	0.38
7	600276	恒瑞医药	126,000	4,058,460.00	0.37
8	600837	海通证券	367,700	3,982,191.00	0.36
9	600030	中信证券	313,000	3,950,060.00	0.36
10	601328	交通银行	798,100	3,719,146.00	0.34

**(四) 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	596,000.00	0.05

8	其他	-	-
9	合计	596,000.00	0.05

**(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	5,960	596,000.00	0.05

截至2013年3月18日, 本基金仅持有以上债券。

**(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

截至2013年3月18日, 本基金未持有资产支持证券。

**(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

截至2013年3月18日, 本基金未持有权证。

**(八) 投资组合报告附注**

1. 自基金合同生效日至2013年3月18日, 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	13,909.84
3	应收股利	-
4	应收利息	28,608.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	146,654.69
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	189,173.26
---	----	------------

#### 4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2013年3月18日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2013年3月18日，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、重大事件揭示

无。

## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（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、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：

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为申银万国证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

## 十三、基金份额的申购与赎回

本节所指的基金份额的申购与赎回适用于本基金的场内申购、赎回业务，本基金场外申购、赎回的具体业务规定和规则另行公告。

### （一）申购、赎回办理的场所

对于在场内申购赎回的投资者，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本基金的申购和赎回。

目前，基金申购、赎回代办证券公司（一级交易商）包括广发证券、东方证券、光大证券、华安证券、平安证券、申银万国证券、银河证券、中信建投证券。本公司将适时增加或调整申购赎回代办券商，并及时公告。

### （二）申购、赎回的开放日和开放时间

#### 1、申购、赎回的开始时间

自 2013 年 3 月 25 日起，本基金开始办理申购、赎回业务。

#### 2、开放日及开放时间

场内投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所的正常交易日的交易时间；但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若上海证券交易所交易时间变更或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （三）申购、赎回的数额限制

场内投资者申购、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 200 万份基金份额。

基金管理人有权对最小申购赎回单位进行更改，并在调整生效前按照相关法律法规的

要求在至少一种指定媒体上公告。

#### （四）申购、赎回的原则

- 1、本基金的场内份额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、本基金场内份额的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、场内申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 4、场内申购赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》和《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指数基金登记结算业务实施细则》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实质利益的前提下调整上述原则，或依据上海证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整上述规则，但应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

#### （五）申购、赎回的程序

##### 1、场内申购和赎回的申请方式

投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时，须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金；投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

##### 2、场内申购和赎回申请的确认

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，则申购申请失败而不予成交。如投资者持有的符合要求的可用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，则赎回申请失败而不予成交。

投资者可在申请当日及时通过其办理申购、赎回的销售网点或以销售网点规定的其他方式查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；投资者赎回获得的股票当日可卖出。即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。

##### 3、场内申购和赎回的清算交收与登记

本基金场内申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《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务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定，对于本基金的场内申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购当日并卖出的基金份额及对应的深交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应的深交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记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。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上交所上市的成份股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。基金管理人于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，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务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

登记结算机构和基金管理人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利益的前提下，对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体公告。

#### （六）场内申购、赎回的对价及费用

1、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。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，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。

2、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上海证券交易所开市

前公告。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。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。

3、申购费用由申购基金份额的投资人承担，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。投资人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申购或赎回份额 0.5% 的标准向投资人收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

#### （七）申购赎回清单的内容与格式

申购、赎回清单适用于本基金的场内申购、赎回业务。

##### 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内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金部分、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。

1) 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”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

禁止现金替代适用于上交所上市的成份股，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。

可以现金替代适用于上交所上市的成份股，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。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

退补现金替代适用于深交所上市的成份股，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，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

##### 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。目前仅适用于沪深 300 指数中的上交所股票。

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×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例） 其中，“参考价格”的确定原则为

（i）该证券正常交易时，采用最新成交价；

（ii）该证券正常交易中出現涨停时，采用涨停价格；

（iii）该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；

（iv）该证券停牌且当日无成交时，采用前一交易日收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

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溢价比例，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溢价比例，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，上海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。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

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及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

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：

$$\text{现金替代比例 (\%)} = \frac{\sum_{i=1}^n \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格}}{\text{申购基金份额} \times \text{参考基金份额净值}} \times 100\%$$

参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

### 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，即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票。

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调整后 T 日开盘参考价。

### 4) 退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于沪深 300 指数中深交所股票。

②替代金额：对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=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×（1+现金替代溢价比例）；

赎回的替代金额=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×（1-现金替代溢价比例）。

③替代金额的处理程序对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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溢价比例，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。

对退补现金替代而言，赎回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后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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溢价比例，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；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，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

其中，调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数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 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 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）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续完成被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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，确定基金应退还申购投资者或申购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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

#### 4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

T 日预估现金部分 = 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证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和)

其中，该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。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。预估现金部分的数值可能为正、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证券的数量与 T 日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中可以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	2012-9-28
基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数基金
基金管理公司名称	易方达基金管理有限公司
一级市场基金代码	510311

##### 2012 年 9 月 27 日信息内容

现金差额（单位：元）	1010.27
最小申购、赎回单位资产净值（单位：元）	2,000,000.00
基金份额净值（单位：元）	1.000

##### 2012 年 9 月 28 日信息内容

预估现金部分（单位：元）	-5866.00
现金替代比例上限	30%

是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位（单位：份）	2,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购，允许赎回

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金溢价比例	固定替代金额
000001	平安银行	1100	退补	10%	14333.00
000002	万科A	4300	退补	10%	35303.00
000009	中国宝安	500	退补	10%	4355.00
000012	南玻A	600	退补	10%	4176.00
000021	长城开发	300	退补	10%	1473.00
000024	招商地产	300	退补	10%	6030.00
000039	中集集团	400	退补	10%	3956.00
000046	泛海建设	600	退补	10%	2142.00
000059	辽通化工	300	退补	10%	1767.00
000060	中金岭南	600	退补	10%	4812.00
000061	农产品	500	退补	10%	2795.00
000063	中兴通讯	900	退补	10%	9522.00
000069	华侨城A	1600	退补	10%	8752.00
000100	TCL集团	3800	退补	10%	7106.00
000157	中联重科	1900	退补	10%	16017.00
000338	潍柴动力	400	退补	10%	7560.00
000401	冀东水泥	200	退补	10%	2360.00
000402	金融街	1100	退补	10%	6523.00
000422	湖北宜化	300	退补	10%	3576.00
000423	东阿阿胶	200	退补	10%	7770.00
000425	徐工机械	500	退补	10%	5190.00
000527	美的电器	900	退补	10%	8262.00
000528	柳工	300	退补	10%	2547.00
000538	云南白药	200	退补	10%	12206.00
000559	万向钱潮	400	退补	10%	1704.00
000562	宏源证券	300	退补	10%	5667.00
000568	泸州老窖	300	退补	10%	11250.00
000581	威孚高科	200	退补	10%	4948.00
000623	吉林敖东	300	退补	10%	4407.00
000625	长安汽车	800	退补	10%	4184.00
000629	攀钢钒钛	1900	退补	10%	7068.00
000630	铜陵有色	300	退补	10%	5784.00
000651	格力电器	900	退补	10%	18927.00
000680	山推股份	400	退补	10%	1904.00
000686	东北证券	100	退补	10%	1603.00
000703	恒逸石化	200	退补	10%	2264.00
000709	河北钢铁	1900	退补	10%	4389.00
000718	苏宁环球	400	退补	10%	2268.00
000725	京东方A	3800	退补	10%	7182.00
000728	国元证券	400	退补	10%	4596.00

000729	燕京啤酒	600	退补	10%	3114.00
000758	中色股份	200	退补	10%	4210.00
000768	西飞国际	500	退补	10%	3565.00
000776	广发证券	100	必须		1340.00
000778	新兴铸管	400	退补	10%	2396.00
000780	平庄能源	200	退补	10%	2090.00
000783	长江证券	700	退补	10%	6342.00
000792	盐湖股份	300	退补	10%	8598.00
000800	一汽轿车	400	退补	10%	2632.00
000807	云铝股份	400	退补	10%	2020.00
000825	太钢不锈	1000	退补	10%	3330.00
000839	中信国安	400	退补	10%	2468.00
000858	五 粮 液	800	退补	10%	26640.00
000869	张 裕 A	100	退补	10%	4556.00
000876	新 希 望	200	退补	10%	2490.00
000878	云南铜业	300	退补	10%	4959.00
000895	双汇发展	100	退补	10%	5850.00
000898	鞍钢股份	800	退补	10%	2728.00
000933	神火股份	400	退补	10%	3240.00
000937	冀中能源	300	退补	10%	3774.00
000960	锡业股份	200	退补	10%	4014.00
000961	中南建设	200	退补	10%	1776.00
000968	煤气化	100	退补	10%	1364.00
000969	安泰科技	200	退补	10%	2500.00
000983	西山煤电	700	退补	10%	9310.00
000999	华润三九	200	退补	10%	4528.00
002001	新和成	200	退补	10%	3656.00
002007	华兰生物	100	退补	10%	2552.00
002024	苏宁电器	2000	退补	10%	12700.00
002038	双鹭药业	100	退补	10%	3483.00
002069	獐子岛	100	退补	10%	1713.00
002073	软控股份	300	退补	10%	2349.00
002081	金螳螂	100	退补	10%	3578.00
002092	中泰化学	400	退补	10%	2984.00
002106	莱宝高科	200	退补	10%	3278.00
002122	天马股份	300	退补	10%	1695.00
002128	露天煤业	200	退补	10%	2566.00
002142	宁波银行	500	退补	10%	4480.00
002146	荣盛发展	200	退补	10%	1686.00
002155	辰州矿业	200	退补	10%	4228.00
002202	金风科技	700	退补	10%	3934.00
002241	歌尔声学	200	退补	10%	7336.00
002299	圣农发展	200	退补	10%	2316.00

002304	洋河股份	100	退补	10%	12200.00
002310	东方园林	100	退补	10%	5777.00
002344	海宁皮城	100	退补	10%	2495.00
002353	杰瑞股份	100	退补	10%	4360.00
002378	章源钨业	100	退补	10%	2565.00
002385	大北农	200	退补	10%	4188.00
002399	海普瑞	100	退补	10%	1980.00
002405	四维图新	200	退补	10%	2512.00
002415	海康威视	200	退补	10%	5420.00
002422	科伦药业	100	退补	10%	4868.00
002431	棕榈园林	100	退补	10%	2250.00
002493	荣盛石化	100	退补	10%	1172.00
002500	山西证券	300	退补	10%	2457.00
002570	贝因美	100	退补	10%	2075.00
002594	比亚迪	100	退补	10%	1413.00
002603	以岭药业	100	退补	10%	2750.00
600000	浦发银行	5000	允许	10%	
600005	武钢股份	1800	允许	10%	
600009	上海机场	400	允许	10%	
600010	包钢股份	1100	允许	10%	
600011	华能国际	1400	允许	10%	
600015	华夏银行	1500	允许	10%	
600016	民生银行	10000	允许	10%	
600019	宝钢股份	2300	允许	10%	
600022	山东钢铁	900	允许	10%	
600028	中国石化	1900	允许	10%	
600029	南方航空	1600	允许	10%	
600030	中信证券	3300	允许	10%	
600031	三一重工	1300	允许	10%	
600036	招商银行	5500	允许	10%	
600037	歌华有线	300	允许	10%	
600048	保利地产	1900	允许	10%	
600050	中国联通	3800	允许	10%	
600058	五矿发展	200	允许	10%	
600062	华润双鹤	200	允许	10%	
600066	宇通客车	200	允许	10%	
600068	葛洲坝	900	允许	10%	
600085	同仁堂	300	允许	10%	
600089	特变电工	1200	允许	10%	
600096	云天化	100	允许	10%	
600100	同方股份	700	允许	10%	
600104	上汽集团	1000	允许	10%	
600108	亚盛集团	600	允许	10%	

600109	国金证券	200	允许	10%
600111	包钢稀土	600	允许	10%
600115	东方航空	1000	允许	10%
600118	中国卫星	200	允许	10%
600123	兰花科创	300	允许	10%
600125	铁龙物流	400	允许	10%
600132	重庆啤酒	100	允许	10%
600143	金发科技	800	允许	10%
600150	中国船舶	200	允许	10%
600153	建发股份	600	允许	10%
600160	巨化股份	300	允许	10%
600166	福田汽车	600	允许	10%
600169	太原重工	800	允许	10%
600170	上海建工	300	允许	10%
600177	雅戈尔	600	允许	10%
600183	生益科技	300	允许	10%
600188	兖州煤业	300	允许	10%
600196	复星医药	500	允许	10%
600208	新湖中宝	800	允许	10%
600216	浙江医药	100	允许	10%
600219	南山铝业	500	允许	10%
600221	海南航空	500	允许	10%
600252	中恒集团	400	允许	10%
600256	广汇能源	900	允许	10%
600259	广晟有色	100	允许	10%
600266	北京城建	200	允许	10%
600267	海正药业	200	允许	10%
600271	航天信息	200	允许	10%
600276	恒瑞医药	300	允许	10%
600307	酒钢宏兴	400	允许	10%
600309	烟台万华	500	允许	10%
600315	上海家化	100	允许	10%
600316	洪都航空	200	允许	10%
600320	振华重工	800	允许	10%
600331	宏达股份	400	允许	10%
600348	阳泉煤业	500	允许	10%
600352	浙江龙盛	500	允许	10%
600362	江西铜业	400	允许	10%
600369	西南证券	500	允许	10%
600372	中航电子	200	允许	10%
600376	首开股份	300	允许	10%
600383	金地集团	2000	允许	10%
600395	盘江股份	200	允许	10%

600406	国电南瑞	400	允许	10%
600415	小商品城	600	允许	10%
600418	江淮汽车	400	允许	10%
600432	吉恩镍业	200	允许	10%
600456	宝钛股份	100	允许	10%
600489	中金黄金	700	允许	10%
600497	驰宏锌锗	300	允许	10%
600498	烽火通信	100	允许	10%
600500	中化国际	300	允许	10%
600508	上海能源	100	允许	10%
600516	方大炭素	300	允许	10%
600518	康美药业	700	允许	10%
600519	贵州茅台	200	允许	10%
600528	中铁二局	300	允许	10%
600535	天士力	100	允许	10%
600546	山煤国际	100	允许	10%
600547	山东黄金	300	允许	10%
600549	厦门钨业	100	允许	10%
600550	天威保变	300	允许	10%
600583	海油工程	900	允许	10%
600585	海螺水泥	900	允许	10%
600588	用友软件	200	允许	10%
600595	中孚实业	300	允许	10%
600598	北大荒	300	允许	10%
600600	青岛啤酒	200	允许	10%
600642	申能股份	1300	允许	10%
600649	城投控股	700	允许	10%
600655	豫园商城	500	允许	10%
600660	福耀玻璃	600	允许	10%
600664	哈药股份	400	允许	10%
600674	川投能源	400	允许	10%
600690	青岛海尔	700	允许	10%
600694	大商股份	100	允许	10%
600703	三安光电	300	允许	10%
600718	东软集团	400	允许	10%
600739	辽宁成大	600	允许	10%
600741	华域汽车	500	允许	10%
600770	综艺股份	300	允许	10%
600779	水井坊	200	允许	10%
600783	鲁信创投	100	允许	10%
600795	国电电力	3400	允许	10%
600804	鹏博士	600	允许	10%
600809	山西汾酒	100	允许	10%

600811	东方集团	600	允许	10%
600812	华北制药	400	允许	10%
600827	友谊股份	300	允许	10%
600832	东方明珠	700	允许	10%
600837	海通证券	3900	允许	10%
600839	四川长虹	1600	允许	10%
600859	王府井	100	允许	10%
600863	内蒙华电	300	允许	10%
600873	梅花集团	400	允许	10%
600875	东方电气	300	允许	10%
600881	亚泰集团	800	允许	10%
600887	伊利股份	700	允许	10%
600893	航空动力	200	允许	10%
600895	张江高科	300	允许	10%
600900	长江电力	2200	允许	10%
600970	中材国际	200	允许	10%
600971	恒源煤电	200	允许	10%
600997	开滦股份	300	允许	10%
600999	招商证券	1300	允许	10%
601001	大同煤业	300	允许	10%
601006	大秦铁路	2600	允许	10%
601009	南京银行	900	允许	10%
601018	宁波港	1700	允许	10%
601088	中国神华	1500	允许	10%
601098	中南传媒	200	允许	10%
601099	太平洋	300	允许	10%
601101	昊华能源	200	允许	10%
601106	中国一重	1200	允许	10%
601111	中国国航	1100	允许	10%
601117	中国化学	900	允许	10%
601118	海南橡胶	500	允许	10%
601158	重庆水务	400	允许	10%
601166	兴业银行	3300	允许	10%
601168	西部矿业	800	允许	10%
601169	北京银行	2300	允许	10%
601179	中国西电	800	允许	10%
601186	中国铁建	1400	允许	10%
601216	内蒙君正	200	允许	10%
601233	桐昆股份	100	允许	10%
601258	庞大集团	200	允许	10%
601268	二重重装	200	允许	10%
601288	农业银行	11200	允许	10%
601299	中国北车	1800	允许	10%

601318	中国平安	1500	允许	10%
601328	交通银行	10400	允许	10%
601333	广深铁路	1300	允许	10%
601336	新华保险	100	允许	10%
601369	陕鼓动力	200	允许	10%
601377	兴业证券	700	允许	10%
601390	中国中铁	2300	允许	10%
601398	工商银行	6900	允许	10%
601555	东吴证券	300	允许	10%
601558	华锐风电	400	允许	10%
601566	九牧王	100	允许	10%
601600	中国铝业	1300	允许	10%
601601	中国太保	1400	允许	10%
601607	上海医药	400	允许	10%
601618	中国中冶	2200	允许	10%
601628	中国人寿	700	允许	10%
601633	长城汽车	200	允许	10%
601666	平煤股份	500	允许	10%
601668	中国建筑	6700	允许	10%
601669	中国水电	1700	允许	10%
601688	华泰证券	1000	允许	10%
601699	潞安环能	400	允许	10%
601717	郑煤机	400	允许	10%
601718	际华集团	500	允许	10%
601766	中国南车	1600	允许	10%
601788	光大证券	600	允许	10%
601808	中海油服	300	允许	10%
601818	光大银行	5400	允许	10%
601857	中国石油	1500	允许	10%
601866	中海集运	1100	允许	10%
601888	中国国旅	100	允许	10%
601898	中煤能源	800	允许	10%
601899	紫金矿业	3500	允许	10%
601901	方正证券	800	允许	10%
601918	国投新集	200	允许	10%
601919	中国远洋	1000	允许	10%
601928	凤凰传媒	300	允许	10%
601933	永辉超市	100	允许	10%
601939	建设银行	4300	允许	10%
601958	金钼股份	400	允许	10%
601988	中国银行	3000	允许	10%
601989	中国重工	2000	允许	10%
601991	大唐发电	900	允许	10%

601992	金隅股份	400	允许	10%
601998	中信银行	1200	允许	10%

#### (八) 拒绝或暂停场内申购的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理投资者的申购申请；
- 2、因特殊原因（包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定临时停市或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；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单；
- 5、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当；
- 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；
- 7、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 8、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第 6 项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。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) 暂停场内赎回或延缓支付场内赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请。
- 2、因特殊原因（包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定临时停市或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。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；
- 5、法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付，基金份额持有人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。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予以公告。

#### (十) 基金的非交易过户、冻结及解冻

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

#### （十一）基金份额的登记和转托管

##### 1、基金份额的登记

本基金份额采用分系统登记的原则。投资者通过认购、二级市场买入或场内申购的基金份额属场内份额，由中国结算负责办理登记结算。

##### 2、基金份额的转托管

本基金的转托管包括场外份额的系统内转托管及场内外份额的跨系统转托管。

条件许可情况下，在基金管理人制定并发布有关规则后，本基金场外份额可跨系统转托管为场内份额，并进行场内赎回、上市交易。但除非基金管理人另行公告，场内份额不可跨系统转托管为场外份额。

#### （十二）集合申购和其他服务

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。

如果上海证券交易所推出 ETF 分级业务，在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可为本基金增设分级份额。基金管理人可就分级后的全部或部分份额申请上市，并制定、公布相应的业务规则。

在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人也可采取其他合理的申购赎回方式，并于新的申购赎回方式开始执行前予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据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。

## 十四、备查文件目录

- （一）中国证监会核准易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金募集的文件；
- （二）《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
- （三）《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书》；
- （四）《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
- （五）法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件和营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

易方达基金管理有限公司

二〇一三年三月二十日

## 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

##### 1、基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。但由于证券市场波动、基金管理人为场外投资者买卖证券时机及申购赎回途径不同等原因，本基金投资者依据基金份额净值所支付、取得的场外申购、赎回现金对价，可能与场内申购、赎回所支付、取得的对价并不等值。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

##### 2、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在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份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金管理人的权利与义务**

### **1、基金管理人的权利**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- (2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (3) 销售基金份额；
- (4) 在符合有关法律法规且不损害基金份额持有人利益的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (7) 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、融券；
- (8) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构，办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用，更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (9) 选择、更换基金销售机构，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督、检查和处理；
- (10) 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；
- (11) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (12) 依法召集基金份额持有人大会；
- (13) 依法募集基金；
- (14) 依据基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；
- (15) 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；
- (16) 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；

(17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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) 计算并公告基金资产净值、基金份额净值，确定基金份额申购赎回清单；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购的份额或赎回的对价；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (13) 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；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- (15) 按照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收益；
- (16) 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；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 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者实施其他法律行为；
- (19) 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；

- (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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 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；
- (24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (26) 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；
- (27) 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前提下得到有关资料的复印件；
- (28) 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；
- (29) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (30) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **1、基金托管人的权利**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- (1) 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；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### **2、基金托管人的义务**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；
- (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应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 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；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 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；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 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；
- (16) 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；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 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；
- (20) 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业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

### (一) 基金份额持有人大会的组成

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人持有的每一基金份额（包括场内份额和场外份额）具有同等的投票权。

2、在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

(二) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和基金合同另有规定时除外）；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据适用的相关规定或法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

(10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(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) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

（三）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或在中国证监会允许的条件下调整收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 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；

(6) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则（包括申购赎回清单的调整、场内及场外开放时间的调整等）；

(7) 标的指数更名或调整指数编制方法，以及变更业绩比较基准；

(8) 基金推出新业务或服务；

(9) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(10) 按照中证指数有限公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费率和计算方法；

(11) 按照法律法规或本基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集人和召集方式

1. 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2. 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，应当自行召集。

3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

4. 代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日报中国证监会备案。

5. 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。

#### （五）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. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由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、表决意见提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，不影响计票和表决结果。

## （六）基金份额持有人出席会议的方式

### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决，基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。

(4) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(5) 会议的召开方式由召集人确定。

### 2. 召开基金份额持有人大会的条件

#### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

#### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本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) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

5) 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提交的持有基金

份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

## （七）议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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 日前提交召集人，并由召集人审核后公告。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 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，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。法律法规另有规定的除外。

(5) 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，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 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。

#### (八) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效, 除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项, 应当依法报中国证监会核准或者备案, 并予以公告。

4. 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, 否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面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, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 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。

#### (九) 计票

##### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集, 则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推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, 基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人; 但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席, 则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## (十) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第(三)条所规定的召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

2. 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。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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

(十一) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，或法律法规关于基金份额持有人大会的规定发生变化时，本基金从其规定。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### (一) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 中国证监会规定的其他情况。

在基金合同生效日三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，

各方当事人不得通过召开持有人大会的方式延续其效力。

## (二) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

### 4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，

律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 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。

#### 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，按照中国国际经济贸易仲裁委员会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。

本基金合同受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。