

**华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开  
华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
基金份额持有人大会的第二次提示性公告**

根据华夏基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于 2021 年 6 月 24 日发布的《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的公告》，本基金管理人决定以通讯方式召开华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，征求本基金基金份额持有人对目标 ETF 即上证 50 交易型开放式指数证券投资基金拟审议事项（《关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案》）的意见。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现将具体事宜提示如下：

**一、召开会议基本情况**

本基金为上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标 ETF”）的联接基金，目标 ETF 将召开基金份额持有人大会审议《关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，征求本基金基金份额持有人对目标 ETF 拟审议事项（即《关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案》）的意见。会议的具体安排如下：

- （一）会议召开方式：通讯方式。
- （二）表决票收取时间：2021 年 6 月 30 日至 2021 年 7 月 25 日 17:00（以收到表决票的时间为准）
- （三）会议计票日：2021 年 7 月 26 日

(四) 会议通讯表决票的送达:

1、会议通讯表决票可直接交送至本基金管理人, 具体联系方式如下:

地址: 华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 1 层 (100033);

联系电话: 010-88087226。

2、会议通讯表决票可邮寄至本基金管理人, 具体联系方式如下:

地址: 北京市西城区月坛南街 1 号院 7 号楼 11 层 (100045);

联系人: 刘金;

联系电话: 010-88066494。

请在信封表面注明:“华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

《关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案》(见附件一)。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2021 年 6 月 29 日, 该日在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

## 四、投票

(一) 本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印获取表决票或登录本基金管理人网站 ([www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)) 下载表决票。

(二) 基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容, 其中:

1、个人持有人自行投票的, 需在表决票上签字, 并提供个人身份证明文件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件。

2、机构持有人自行投票的, 需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章(以下合称“公章”), 并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等); 合格境外机构投资者自行投票的, 需在表决票上加盖

本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证明文件复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

3、个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人持有人身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

4、机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

5、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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书证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

6、以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以本基金管理人的认可为准。

（三）基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件

于 2021 年 6 月 30 日至 2021 年 7 月 25 日 17:00 期间（以收到表决票的时间为准），通过专人送交、快递或邮寄的方式提交给本基金管理人。

## 五、授权

为便于基金份额持有人参与本次大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以委托代理人代其行使表决权。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权委托他人在基金份额持有人大会上表决的，需符合以下规则：

### （一）委托人

本基金的基金份额持有人可按“（三）授权方式”列明的方式授权委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权委托他人代理行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，每一份基金份额享有一票表决权，如基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额，则授权无效。基金份额持有人在权益登记日是否持有本基金基金份额以及所持有的基金份额数额以本基金登记机构最终确认的数据为准。

### （二）受托人

基金份额持有人可以授权委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构或个人，代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。为保证基金份额持有人有效行使权利，建议基金份额持有人选择本基金的基金管理人为受托人。

本基金管理人可以根据有关情况向基金份额持有人建议增加受托人名单，并另行公告。

### （三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话、短信以及法律法规和中国证监会认可的其他方式进行授权，授权方式及程序应符合以下规定：

#### 1、纸面授权

##### （1）授权委托书样本

基金份额持有人通过纸面方式授权的，需填写授权委托书（见附件三）。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录本基金管理人网站

(www.ChinaAMC.com) 下载等方式获取授权委托书样本。

## (2) 纸面授权所需提供的文件

①个人持有人授权委托他人代理行使表决权的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件，并提供委托人个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构持有人授权委托他人代理行使表决权的，应由委托人填妥授权委托书原件并在授权委托书原件上加盖委托人公章，并提供委托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

## (3) 纸面授权文件的送交

基金份额持有人可选择直接送交、邮寄、柜台办理 3 种方式送交纸面授权文件，具体如下：

### ①直接送交

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件直接送交至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

地址：华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 1 层（100033）；

联系电话：010-88087226。

### ②邮寄

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件邮寄至本基金管理人。具体地址和联系方式如下：

地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 7 号楼 11 层（100045）；

联系人：刘金；

联系电话：010-88066494。

### ③柜台办理

基金份额持有人也可在会议召开前到本基金管理人柜台办理授权，填写授权委托书，并提交身份证明文件。具体地址及联系方式如下：

地址：华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 1 层（100033）；

联系电话：010-88087226。

#### 2、电话授权（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会，基金份额持有人可拨打本基金管理人客户服务电话(400-818-6666 转人工，免收长途话费)，并按提示确认身份后进行授权。

本基金管理人和本基金主要销售机构的呼叫中心也可主动与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后，根据基金份额持有人意愿进行授权记录并完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

#### 3、短信授权（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会，本基金管理人可以通过短信平台向预留有效手机号码的基金份额持有人发送授权征集短信，基金份额持有人可回复短信表明授权意见。

### （四）授权效力确定规则

#### 1、直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，后又直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

#### 2、纸面优先规则

如果同一基金份额持有人通过纸面及其他多种方式进行了有效授权，不论授权时间先后，均以有效的纸面授权为准。

#### 3、最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次通过同一种方式或纸面以外的其他不同方式进行有效授权，无论授权意向是否相同，均以最后一次授权为准。

#### （五）授权时间的确定

如基金份额持有人通过纸面方式进行授权，授权时间以本基金管理人收到授权委托书的时间为准。如基金份额持有人通过非纸面方式进行授权，授权时间以系统记录时间为准。

如果授权时间相同但授权意见不一致，视为委托人授权受托人选择一种表决意见进行表决。

#### （六）授权截止时间

本基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2021年7月25日17:00。

### 六、计票

（一）本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管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。

（二）基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

（三）表决票效力的认定如下：

1、表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在规定时间之前送达指定收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内之前送达指定收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

(1) 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

(2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

(3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本基金管理人指定收件人收到的时间为准。

## 七、决议生效条件

(一) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 1/2(含 1/2)；

(二) 如果本次基金份额持有人大会成功召开的，本基金管理人将就全部表决意见进行分类统计，以此确定权益登记日本基金基金份额持有人大会各类表决意见的具体比例（比例以百分数表示，分子四舍五入精确到小数点后两位）。本基金管理人将分别按照上述分类表决意见的具体比例以及本基金持有的目标 ETF 的总份额，参加目标 ETF 基金份额持有人大会并据此投票表决；

(三) 基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在通过之日起 5 日内报中国证监会备案，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

## 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2），基金份额持有人大会方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，但目标 ETF 成功召开基金份额持有人大会的，考虑到该种情况下目标 ETF 的基金份额持有人大会已经成功召开，本基金管理人将不再就同一议案重新召集本基金基金份额持有人大会。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，目标 ETF 也未成功召开基金份额持有人大会，且目标 ETF 根据《中华人民共和国证券投资基金

法》的规定在规定的时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会的，本基金管理人可以在规定时间内就同一议案重新召集本基金的基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 九、本次大会相关机构

（一）召集人：华夏基金管理有限公司

客户服务电话：400-818-6666；

联系人：杨霞；

网址：[www.chinaAMC.com](http://www.chinaAMC.com)。

（二）基金托管人：中国工商银行股份有限公司

（三）公证机关：北京市中信公证处

电话：010-81139046；

联系人：甄真。

（四）见证律师：北京市天元律师事务所

## 十、重要提示

（一）上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订说明见附件四。

（二）请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

（三）投资者可登录本基金管理人网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666）了解本次基金份额持有人大会相关事宜。

（四）本会议通知的有关内容由华夏基金管理有限公司负责解释。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇二一年六月二十六日

附件一：《关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案》

附件二：《华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订说明》

附件一：

**关于上证 50 交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案**

华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人：

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等有关规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏上证 50ETF”）的基金份额持有人大会，审议华夏上证 50ETF 参与融资及转融通证券出借业务、股指期货、股票期权等衍生品投资并修订基金合同事宜。《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订说明》见附件四。

为实施本次会议议案，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于确定华夏上证 50ETF 参与融资及转融通证券出借业务、股指期货、股票期权等衍生品投资的具体时间，根据本次审议事项对华夏上证 50ETF 基金合同进行修订，并根据现时有效的法律法规及基金实际投资运作情况在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对华夏上证 50ETF 基金合同进行其他必要的修订和补充。

以上议案，请予审议。

华夏基金管理有限公司  
二〇二一年六月二十六日

附件二：

**华夏上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
基金份额持有人大会通讯表决票**

基金份额持有人名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）	基金账户号		
受托人（代理人）姓名/名称：	受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：		
审议事项	同意	反对	弃权
关于上证50交易型开放式指数证券投资基金参与转融通证券出借业务及衍生品投资等相关事项并修订基金合同的议案			
基金份额持有人/受托人签名或盖章			
日期      年      月      日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。 “基金账户号”仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。			

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.chinaamc.com）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

### 授权委托书

兹委托 \_\_\_\_\_ 代表本人（或本机构）参加投票截止日为2021年7月25日的以通讯方式召开的华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若华夏上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

委托人身份证号或营业执照注册号： \_\_\_\_\_

委托人基金账户号： \_\_\_\_\_

受托人签字/盖章： \_\_\_\_\_

受托人身份证明编号： \_\_\_\_\_

委托日期： \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

附注：

- 1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。
- 3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

## 上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏上证 50ETF”）基金份额持有人大会，审议华夏上证 50ETF 参与融资及转融通证券出借业务、股指期货、股票期权等衍生品投资并修订基金合同事宜。基金管理人已据此对基金合同中“释义”、“基金的投资”、“基金资产估值”、“基金合同当事人及权利义务”、“基金的信息披露”等相关章节进行了修订，并根据现时有效的法律法规及基金实际投资运作情况对基金合同进行了其他必要修订和补充，同时相应修订了华夏上证 50ETF 托管协议、招募说明书(更新)及产品资料概要。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。现将基金合同主要修订情况公告如下（具体修订详见附件）：

一、在“释义”中新增“转融通证券出借业务”释义如下：

**“转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。”**

二、在“基金合同的当事人及其权利与义务（一）基金管理人 2.基金管理人的权利”中新增有关参与融券及转融通证券出借业务的权利约定如下：

**“（10）在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务等；”**

三、对“基金的投资”的修订

（一）将“（二）投资范围”修订为：

**“本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期**

票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的(包括但不限于股指期货等金融衍生品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

通常情况下,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,本基金在每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

(二)在“(四)投资策略”中增加债券、衍生品、资产支持证券、融资及转融通证券出借业务的投资策略如下:

## “2、债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。基金还可参与风险低且可控的债券回购等投资。

## 3、衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标,基金还有权投资于股指期货、股票期权。

基金参与股指期货交易,应当根据风险管理的原则,以套期保值为目的。在此基础上,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

基金参与股票期权交易,应当按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的。基金管理人将根据审慎原则,建立期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。

#### 5、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。

利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。

为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。”

(三) 删除“(八) 禁止行为”中第4项，具体删除内容如下：

“4.买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外”。

(四) 根据投资范围修订“(九) 投资限制”如下：

“基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；

(2) 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%；

(3) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

(8) 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%, 进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(9) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%, 在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(10) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(11) 基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%; 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物; 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易

对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

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

(16) 本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；

B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述 (6)、(13)、(14)、(16) 项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述 (16) 规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。”

#### 四、对“基金资产的估值”的修订

(一) 在“估值方法”中增加期权、股指期货、融资及转融通证券出借的估值方法，删除权证估值方法，同时细化并调整股票、债券等资产估值方法，具体修订如下：

##### “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（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价

(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)交易所上市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。

(3)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。

(4)交易所上市交易的可转换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进行估值。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。

(5)交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值。

(2)首次公开发行未上市的股票、债券,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)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、本基金投资期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

7、基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

9、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。

10、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。”

五、在“基金的信息披露（五）公开披露的基金信息”中新增参与期权、股指期货、资产支持证券、融资及转融通证券出借业务的信息披露约定如下：

#### “12. 投资股指期货的相关公告

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露的股指期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### 13.投资期权的相关公告

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示期权交易对基金总体风险的影响等。

#### 14.投资资产支持证券的相关公告

在中期报告、年度报告等定期报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

在季度报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### 15.参与融资及转融通证券出借业务的信息披露

本基金参与融资及转融通证券出借业务的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。”

六、除与基金合同修订内容一致部分外，基金管理人还对华夏上证 50ETF 招募说明书（更新）进行了补充修订如下：

（一）将“十五、基金的收益与分配（四）基金收益分配数额的确定原则”中原第 3 点“计算截至收益评价日本基金的可分配收益”删除，将原第 4 点由“基金收益分配数额为上述计算的基金超过标的指数的收益、本基金可分配收益中的较小值。”修订为“基金收益分配数额由基金管理人根据上述计算的基金超过标的指数的收益结合实际情况确定。”

（二）在“十九、风险揭示”中新增有关衍生品投资、资产支持证券投资、转融通证券出借业务的风险揭示如下：

#### “16、衍生品投资风险

本基金可投资于股指期货、股票期权等金融衍生品，投资期货、期权等金融衍生品主要存在以下风险：

（1）市场风险：是指由于衍生品价格变动而给投资者带来的风险。

（2）流动性风险：是指由于衍生品合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险：是指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(4) 保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(5) 信用风险：是指经纪公司违约而产生损失的风险。

(6) 操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

#### 17、资产支持证券投资风险

(1) 流动性风险：即证券的流动性下降从而给证券持有人带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）的可能性。

(2) 证券提前赎回风险：若某些交易赋予 SPV 在资产支持证券发行后一定期限内以一定价格向投资者收购部分或全部证券的权利，则在市场条件许可的情况下，SPV 有可能行使这一权利从而使投资者受到不利影响。

(3) 再投资风险：指证券因某种原因被提前清偿，投资者不得不将证券提前偿付资金再做其他投资时面临的再投资收益率低于证券收益率导致投资者不能实现其参与证券化交易所预计的投资收益目标的可能性。

(4) SPV 违约风险：在以债务工具（债券、票据等）作为证券化交易载体，也即交易所发行的证券系债权凭证的情况下，SPV 系投资者的债务人，其可能发生违约从而给投资者造成损失。

#### 18、参与转融通证券出借业务风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：

##### (1) 流动性风险

面临大额赎回时，可能因证券出借原因，无法及时收回出借证券、无法及时变现支付赎回对价的风险。

##### (2) 信用风险

证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

##### (3) 市场风险

**证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。”**

如本次基金份额持有人大会议案获得通过，基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效公告中公告上述修订事项的生效日期，即华夏上证 50ETF 参与融资及转融通证券出借业务、股指期货、股票期权等衍生品投资的起始日期，请投资者关注。基金管理人将于修订生效当日发布华夏上证 50ETF 更新后的基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要，届时投资者可登录本公司网站（[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)）查阅。

附表：华夏上证 50ETF 基金合同修订对照表

附表：华夏上证 50ETF 基金合同修订对照表

章节	标题	修订前	修订后
全文		<p>指定媒介</p> <p>指定报刊</p> <p>指定网站</p> <p>在至少一种中国证监会指定媒介公告</p> <p>权利登记日</p> <p>具有从事证券相关业务资格的会计师事务所</p>	<p><i>规定媒介</i></p> <p><i>规定报刊</i></p> <p><i>规定网站</i></p> <p><i>在中国证监会规定媒介公告</i></p> <p><i>权益登记日</i></p> <p><i>符合《证券法》规定的会计师事务所</i></p>
一、前言		<p>为保护基金投资者合法权益、明确基金合同当事人的权利与义务、规范上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）运作，依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定，遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益的原则，订立《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）。本基金合同是规定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事</p>	<p>为保护基金投资者合法权益、明确基金合同当事人的权利与义务、规范上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）运作，依据《<b>中华人民共和国民法典</b>》《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、<b>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</b>（以下简称“《销售办法》”）、<b>《公开募集证券投资基金运作管理办法》</b>（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定，遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益的原则，订立《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）。本基金合同是规定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同签订</p>

	<p>人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>.....</p> <p><b>本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</b></p>	<p>并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>.....</p>
<p>二、释义</p>	<p>中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；</p> <p>《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时作出的修订；</p> <p>《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时作出的修订；</p> <p>基金托管人：指中国工商银行；</p> <p>合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的规定，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构和保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；</p> <p>标的指数：指上海证券交易所编制并发布的上证 50 指数及其未来可能发生的变更；</p> <p>指定交易：指《上海证券交易所全面指定交易</p>	<p><b>中国银保监会：指中国银行保险监督管理委员会；</b></p> <p><b>《销售办法》：指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；</b></p> <p><b>《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；</b></p> <p>基金托管人：指中国工商银行股份有限公司；</p> <p><b>合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者；</b></p> <p>标的指数：指上证 50 指数及其未来可能发生的变更；</p> <p>指定交易：指《上海证券交易所指定交易实施细则》中定义的“指定交易”；</p>

		<p>制度试行办法》中定义的“全面指定交易”；</p> <p>指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；</p> <p>流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。</p>	<p>规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；</p> <p>流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券、<b>转融通证券出借业务中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券等；</b></p>
		无右侧释义。	<p><b>转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。</b></p>
三、基金的基本情况	(八)	<p>(八) 标的指数：上证 50 指数。</p> <p>.....</p> <p>在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。</p> <p>.....</p>	<p>(八) 标的指数：上证 50 指数。</p> <p>.....</p> <p><b>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照<b>指数编制机构提供</b>的最近一个交易日的指数信息<b>遵循基金份额持有人利益优先原则</b>维持基金投资运作。</b></p> <p>.....</p>
五、基金备案	(五) 基金合同生效后的基金份额持有人数量	<p>基金合同生效后，如连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金财产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。</p>	<p><b>《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作</b></p>

	和资产规模		<p>日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>
七、基金份额的交易	(二) 基金份额的上市交易	<p>本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海、深圳证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。</p>	<p>本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所以交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。</p>
八、基金份额的申购与赎回	(七) 暂停申购、赎回的情形	<p>在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请：</p> <p>.....</p> <p>2.上海证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3.上海证券交易所、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；</p> <p>.....</p> <p>6.法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。</p>	<p>在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请：</p> <p>.....</p> <p>2.上海证券交易所/期货交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3.上海证券交易所/期货交易所、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；</p> <p>.....</p> <p>6.法律法规规定或中国证监会<b>认定</b>的其他情形。</p>
十一、基金合同的当事人及其权利与义务	(一) 基金管理人 2. 基金管理人的权利	<p>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：</p> <p>.....</p> <p>(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监</p>	<p>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：</p> <p>.....</p> <p>(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监</p>

	<p>会、中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；</p> <p>.....</p> <p>(10) 在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资，<b>并以相应基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；</b></p> <p>.....</p>	<p>会、<b>中国银保监会</b>，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；</p> <p>.....</p> <p>(10) 在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资、<b>融券及转融通证券出借业务等；</b></p> <p>.....</p>
<p>(一) 基金管理人</p> <p>3.基金管理人的义务</p>	<p>.....</p> <p>(12) 编制中期和年度<b>基金</b>报告；</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(12) 编制<b>季度</b>、中期和年度报告；</p> <p>.....</p>
<p>(二) 基金托管人</p> <p>1.基本情况</p>	<p>名称：中国工商银行</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：姜建清</p> <p>成立日期：1984 年 1 月 1 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[1998]3 号文</p> <p>组织形式：国有独资企业</p> <p>注册资本：1710.24 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>名称：中国工商银行<b>股份有限公司</b></p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>成立日期：1984 年 1 月 1 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[1998]3 号文</p> <p>组织形式：<b>股份有限公司</b></p> <p>注册资本：<b>人民币 334,018,850,026 元</b></p> <p>存续期间：持续经营</p>
<p>(二) 基金托管人</p> <p>3.基金托管人的义务</p>	<p>.....</p> <p>(8) 对基金财务会计报告、中期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；</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(8) 对基金财务会计报告、<b>季度</b>、中期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；</p> <p>.....</p>

<p>十二、基金份额持有人大会</p>	<p>(一) 召开事由</p>	<p>有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.变更基金类别；</li> <li>2.变更基金投资目标、范围或策略；</li> <li>3.变更基金份额持有人大会程序；</li> <li>4.提前终止基金合同；</li> <li>5.转换基金运作方式；</li> <li>6.提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；</li> <li>7.更换基金管理人、基金托管人；</li> <li>8.提前终止基金上市，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；</li> <li>9.与其他基金合并；</li> <li>10.中国证监会规定的其他情形。</li> </ol> <p>以下情形不需召开基金份额持有人大会：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.调低基金管理费率、基金托管费率；</li> <li>2.暂停办理基金申购、赎回业务；</li> <li>3.因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；</li> <li>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变化；</li> <li>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；</li> <li>6.按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</li> </ol>	<p>有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.变更基金类别；</li> <li>2.变更基金投资目标、范围或策略；</li> <li>3.变更基金份额持有人大会程序；</li> <li>4.提前终止基金合同；</li> <li>5.转换基金运作方式；</li> <li>6.调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</li> <li>7.更换基金管理人、基金托管人；</li> <li>8.提前终止基金上市，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；</li> <li>9.与其他基金合并；</li> <li>10.基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；</li> <li>11.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；</li> <li>12.中国证监会规定的其他情形。</li> </ol> <p>以下情形不需召开基金份额持有人大会：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.暂停办理基金申购、赎回业务；</li> <li>2.因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；</li> <li>3.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变化；</li> <li>4.对基金合同的修改对基金份额持有人利</li> </ol>
---------------------	-----------------	---	--

			<p>益无实质性不利影响；</p> <p>5.按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p>
	<p>(二) 召集人和召集方式</p>	<p>1.在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集。</p> <p>2.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。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。</p> <p>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。基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人</p>	<p>1.在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集。</p> <p>2.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。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<b>由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</b></p> <p>3.代表基金份额 10%以上（<b>含 10%</b>）的基金份额持有人<b>就同一事项书面要求</b>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（<b>含 10%</b>）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</p>

		<p>大会的，基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前 30 日向中国证监会备案。</p>	<p>托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p><b>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。</b></p> <p><b>5.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。</b></p>
<p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p>		<p>召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会，<b>但更换基金管理人和基金托管人、提前终止基金合同、转换基金运作方式必须以现场方式召开。</b></p> <p>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书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。</p> <p>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：</p> <p>（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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；</p> <p>（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登</p>	<p>召集人可选择以现场开会、通讯开会方式召开基金份额持有人大会<b>或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</b></p> <p>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书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。</p> <p>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：</p> <p>（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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；</p> <p>（2）经核对，汇总到会者出示的在<b>权益登</b></p>

	<p>记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上。</p> <p>2.通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。</p> <p>在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(1) 大会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；</p> <p>(2) 大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；</p> <p>(3) 大会召集人在公证机构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书面表决意见；</p> <p>(4) 所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上；</p> <p>(5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。</p>	<p><b>记日</b>持有基金份额的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在<b>权益登记日</b>基金总份额的二分之一以上(含二分之一)。若<b>到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。</b></p> <p>2.通讯方式开会。<b>通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知约定的其他方式进行表决。</b></p> <p>在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(1) 大会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；</p> <p>(2) 大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；</p> <p>(3) 大会召集人在公证机构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书面表决意见；</p>
--	--	--

			<p>(4) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 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二分之一(含二分之一); 若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;</p> <p>(5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人, 同时提交的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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定, 并与基金登记机构记录相符。</p>
	<p>(五) 议事内容与程序</p>	<p>1. 议事内容</p> <p>议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项, 如变更基金类别, 变更基金投资目标、范围或策略, 变更基金份额持有人大会程序, 提前终止基金合同, 转换基金运作方式, 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 更换基金管理人、基金托管人, 提前终止基金上市, 与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。</p>	<p>1. 议事内容</p> <p>议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项, 如变更基金类别, 变更基金投资目标、范围或策略, 变更基金份额持有人大会程序, 提前终止基金合同, 转换基金运作方式, <del>调整</del>基金管理人、基金托管人的报酬标准, 更换基金管理人、基金托管人, 提前终止基金上市, 与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。</p>

	<p>基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。</p> <p>2.议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照下列第(六)款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。基金份额持有人大会由基金管理人召集的, 大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表; 基金份额持有人大会由基金托管人召集的, 大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表; 基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的, 大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定, 则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上 (<del>不含</del> 50%) <del>多数</del> 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。</p> <p>(2) 通讯方式开会</p> <p>在通讯方式开会的情况下, 由召集人至少提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决, 在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机构监督下形成的决议有效。</p>	<p>基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。</p> <p>2.议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照下列第(六)款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。基金份额持有人大会由基金管理人召集的, 大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表; 基金份额持有人大会由基金托管人召集的, 大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表; 基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的, 大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定, 则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上 (<del>含</del> 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。</p> <p>(2) 通讯方式开会</p> <p>在通讯方式开会的情况下, 由召集人至少提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期 <del>后二个工作日内</del> 统计全部有效表决, 在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机构监督下形成的决议有效。</p>
<p>(六) 决议形成的条件、表</p>	<p>基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:</p> <p>(1) 一般决议须经出席会议的基金份额</p>	<p>基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:</p> <p>(1) 一般决议, <del>一般决议须经参加大会的</del></p>

<p>决方式、 程序 1.决 议形成的 条件</p>	<p>持有人所持表决权的 50%以上（不含 50%）多数通过方为有效；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。</p> <p>（2）特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方为有效。</p> <p>转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过。</p>	<p><b>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。</b></p> <p>（2）<b>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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</b></p>
<p>（六）决 议形成的 条件、表 决方式、 程序 3.表 决程序 （1）现 场开会</p>	<p>无右侧内容。</p>	<p><b>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。</b></p>
<p>（七）</p>	<p>（七）基金份额持有人大会决议报中国证监会<b>核准或</b>备案后的公告时间、方式</p> <p>基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会<b>核准或者</b>备案。基金份额持有人大会决定的事项自<b>中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起</b>生效。</p> <p>.....</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起<b>5</b>个工作日内在至少一种中国证监会指定媒介公告。</p>	<p>（七）基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式</p> <p>基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自<b>表决通过之日起</b>生效。</p> <p>.....</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起<b>2</b>个工作日内在中国证监会规定媒介公告。</p>

		无右侧内容。	<p>(八) 关于本基金的联接基金所持本基金份额行使表决权的方式</p> <p>本基金的联接基金可以按照联接基金的基金合同的约定参加本基金的基金份额持有人大会。</p>
	(一) 基金管理人的更换 1. 基金管理人职责终止的条件	<p>有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>……</p> <p>(4) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。</p>	<p>有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>……</p> <p>(4) 法律法规规定及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他情形。</p>
十三、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序	(一) 基金管理人的更换 3. 基金管理人的更换程序	<p>原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金管理人。如有必要，在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。</p> <p>(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议。</p> <p>(3) 批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任。</p> <p>(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后5个工作日内在中国证监会指定媒介公告。新任基金管理人与原基金管理人或临时基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任基金管理人和新任基金托管人在中国证监会和中国银监会批准后5个工作日内在中国证监</p>	<p>原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金管理人。如有必要，在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。</p> <p>(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议。</p> <p>(3) 备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案。</p> <p>(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告。新任基金管理人与原基金管理人或临时基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，新任基金管理人和新任基金托管人应当依照有关规定予以公告并报中国证监会备</p>

		会指定媒介联合公告。	<b>案。</b>
	(二) 基金托管人的更换 1. 基金托管人职责终止的条件	<p>有下列情形之一的，基金托管人职责终止：</p> <p>……</p> <p>(4) 法律法规规定或经中国证监会、中国银监会批准的其他情形。</p>	<p>有下列情形之一的，基金托管人职责终止：</p> <p>……</p> <p>(4) 法律法规规定<b>及</b>中国证监会<b>规定和《基金合同》约定的</b>其他情形。</p>
	(二) 基金托管人的更换 3. 基金托管人的更换程序	<p>原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。如有必要，在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金托管人形成决议。</p> <p>(3) 批准：新任基金托管人经中国证监会、中国银监会审查批准方可继任。</p> <p>(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会、中国银监会批准后5个工作日内在中国证监会指定媒介公告。新任基金托管人与原基金托管人或临时基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任基金管理人和新任基金托管人在中国证监会和中国银监会批准后5个工作日内在中国证监会指定媒介联合公告。</p>	<p>原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。如有必要，在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名。</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金托管人形成决议。</p> <p>(3) <b>备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案。</b></p> <p>(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在<b>更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在</b>规定媒介公告。新任基金托管人与原基金托管人或临时基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，新任基金管理人和新任基金托管人<b>应当依照有关规定予以公告并报中国证监会备案。</b></p>
十六、基金的投资	(二) 投资范围	<p>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</p>	<p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。<b>为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含创业板及其他中国证监会注</b></p>

		<p>资的其他金融工具。</p> <p>本基金投资范围中的股票包含存托凭证。</p>	<p>册或核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的(包括但不限于股指期货等金融衍生品),基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资范围中的股票包含存托凭证。</p> <p>通常情况下,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,本基金在每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
	<p>(四) 投资策略</p>	<p>.....</p> <p>3.投资程序</p> <p>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。</p> <p>(1)研究:金融工程小组依托公司整体研</p>	<p><b>1、组合复制与替代性策略</b></p> <p>.....</p> <p>3) 投资程序</p> <p>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。</p>

	<p>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、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。</p> <p>(2) 投资决策：投资决策委员会依据<b>金融工程小组</b>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。</p> <p>(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。</p> <p>(4) 交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。</p> <p>(5) 投资绩效评估：金融工程小组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。</p> <p>(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。</p> <p>基金管理人在确保基金份额持有人利益</p>	<p>(1) 研究：<b>基金经理小组、研究人员</b>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、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。</p> <p>(2) 投资决策：投资决策委员会依据研究报告，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。<b>基金经理小组</b>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。</p> <p>(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，<b>基金经理小组</b>以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，<b>基金经理小组</b>将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。</p> <p>(4) 交易执行：<b>交易管理部</b>负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。</p> <p>(5) 投资绩效评估：<b>风险管理部</b>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，<b>基金经理小组</b>可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。</p> <p>(6) 组合监控与调整：<b>基金经理小组</b>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。</p>
--	--	---

	<p>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。</p>	<p>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。</p> <p><b>2、债券投资策略</b></p> <p>结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。基金还可参与风险低且可控的债券回购等投资。</p> <p><b>3、衍生品投资策略</b></p> <p>为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权。</p> <p>基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。</p> <p>基金参与股票期权交易，应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p><b>4、资产支持证券投资策略</b></p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场</p>
--	---	--

			<p>利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。</p> <p>5、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。</p> <p>利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。</p> <p>为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因子的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。</p>
	<p>(五) 投资组合管理</p>	<p>1.投资组合的建立</p> <p>.....</p> <p>(2)确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。</p>	<p>1.投资组合的建立</p> <p>.....</p> <p>(2)确定建仓策略：基金经理小组根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。</p>

		<p>(3) 逐步调整: 通过完全复制法最终确定目标组合之后, 基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。</p> <p>.....</p> <p>2. 每日投资组合管理</p> <p>.....</p> <p>(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析: 基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因, 并进行成份股调整的流动性分析。</p> <p>3. 定期投资组合管理</p> <p>.....</p> <p>每月末, 在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况, 找出未能有效控制较大偏离的原因。</p> <p>每月末, 公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。</p> <p>(2) 每半年 (标的指数调整周期)</p> <p>根据标的指数的编制规则及调整公告, 基金经理依据投资决策委员会的决策, 在指数成份股调整生效前, 分析并确定组合调整策略, 尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。</p> <p>4. 投资绩效评估</p> <p>(1) 每日, 基金经理分析基金的跟踪偏离度。</p> <p>(2) 每月末, 金融工程小组对本基金的运</p>	<p>(3) 逐步调整: 通过完全复制法最终确定目标组合之后, <b>基金经理小组</b>在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。</p> <p>.....</p> <p>2. 每日投资组合管理</p> <p>.....</p> <p>(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析: <b>基金经理小组</b>分析实际组合与目标组合的差异及其原因, 并进行成份股调整的流动性分析。</p> <p>3. 定期投资组合管理</p> <p>.....</p> <p>每月末, 在<b>基金经理小组</b>会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况, 找出未能有效控制较大偏离的原因。</p> <p>每月末, 公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。<b>基金经理小组</b>根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。</p> <p>(2) 每半年 (标的指数调整周期)</p> <p>根据标的指数的编制规则及调整公告, <b>基金经理小组</b>依据投资决策委员会的决策, 在指数成份股调整生效前, 分析并确定组合调整策略, 尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。</p> <p>4. 投资绩效评估</p> <p>(1) 每日, <b>基金经理小组</b>分析基金的跟踪偏离度。</p>
--	--	---	--

	<p>行情况进行量化评估。</p> <p>(3) 每月末, 基金经理根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况, 重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。</p> <p>.....</p>	<p>(2) 每月末, <b>风险管理部</b>对本基金的运行情况进行量化评估。</p> <p>(3) 每月末, <b>基金经理小组</b>根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况, 重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。</p> <p>.....</p>
(八) 禁止行为	<p>依照《基金法》, 基金财产不得用于下列投资或者活动:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承销证券;</li> <li>2. 违反规定向他人贷款或者提供担保;</li> <li>3. 从事承担无限责任的投资;</li> <li>4. <b>买卖其他基金份额, 但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;</b></li> <li>5. 向基金管理人、基金托管人出资;</li> <li>6. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;</li> <li>7. 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。</li> </ol> <p>法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制。</p>	<p>依照《基金法》, 基金财产不得用于下列投资或者活动:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承销证券;</li> <li>2. 违反规定向他人贷款或者提供担保;</li> <li>3. 从事承担无限责任的投资;</li> <li>4. 向基金管理人、基金托管人出资;</li> <li>5. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;</li> <li>6. 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。</li> </ol> <p>法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制。</p>
(九) 投资限制	<p>依照《运作办法》, 基金管理人运用基金财产进行证券投资, 不得有下列情形:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 基金财产参与股票发行申购, 单只基金所申报的金额超过基金总资产, 单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</li> </ol>	<p><b>基金的投资组合应遵循以下限制:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) <b>基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%;</b></li> <li>(2) <b>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%;</b></li> </ol>

		<p>2.违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；</p> <p>3.本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>4.本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>5.本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</p> <p>6.中国证监会规定禁止的其他情形。</p>	<p>(3)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(4) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(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%；</p> <p>(6) 本基金应投资于信用级别评级为 <b>BBB</b> 以上（含 <b>BBB</b>）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；</p> <p>(7)基金财产参与股票发行申购，<b>本</b>基金所申报的金额<b>不</b>超过<b>本</b>基金的总资产，<b>本</b>基金所申报的股票数量<b>不</b>超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(8) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(9)本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金所持有的股票</p>
--	--	--	---

			<p>市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>(10) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</p> <p>(11) 基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%; 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物; 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;</p> <p>(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%;</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与</p>
--	--	--	---

			<p>基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(15) 在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>(16) 本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：</p> <p>A、出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；</p> <p>B、参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；</p> <p>C、最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；</p> <p>D、本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。</p> <p>(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。</p> <p>(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述 (6)、(13)、(14)、(16) 项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金</p>
--	--	--	---

			<p>投资不符合上述（16）规定的，基金管理人不得新增证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p>
<p>十八、基金资产的估值</p>		<p>无右侧内容。</p>	<p>（二）估值原则</p> <p>基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。</p> <p>（1）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</p> <p>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</p> <p>（2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采</p>

			<p>用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</p> <p>(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。</p>
	<p>(二) 估值方法</p>	<p>(二) 估值方法</p> <p>1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>(2) 未上市股票的估值：</p> <p>①首次发行未上市的股票，按成本或估值技术确定公允价值；</p> <p>②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；</p> <p>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估值；</p> <p>④非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；</p> <p>(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)一(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>1、 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估</p>

	<p>是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)一(2)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；</p> <p>(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>2、债券估值方法：</p> <p>(1) 证券交易所市场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，按最近交易日的收盘价估值；</p> <p>(2) 证券交易所市场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应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日计算的净价估值；</p> <p>(3) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用成本或估值技术确定公允价值；</p> <p>(4) 发行未上市债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，按成本进行后续计量；</p> <p>(5) 在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；</p> <p>(6) 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；</p> <p>(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本</p>	<p>值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。</p> <p>(4) 交易所上市交易的可转换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进行估值。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。</p> <p>(5) 交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外)，选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值。</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，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。</p> <p>(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受</p>
--	--	---

	<p>项第(1)一(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)一(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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；</p> <p>(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p><b>3、权证估值方法：</b></p> <p>(1)基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；</p> <p>未上市交易的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，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；</p>	<p><b>限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</b></p> <p><b>3、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，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。</b></p> <p><b>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</b></p> <p><b>5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</b></p> <p><b>6、本基金投资期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。</b></p> <p><b>7、基金参与融资和转融通证券出借业务的，应参照行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。</b></p> <p><b>8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</b></p> <p><b>9、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。</b></p> <p><b>10、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。</b></p> <p><b>11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金</b></p>
--	---	---

	<p><b>(3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。</b></p> <p>4、本基金投资存托凭证的估值核算, 依照境内上市交易的股票执行。</p> <p>5、其他资产的估值方法</p> <p>其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。</p> <p>6、特殊情况的处理</p> <p>基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(2)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。</p> <p>当基金份额净值出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大; 当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当报中国证监会备案; 当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告, 并同时报中国证监会备案。</p>	<p>份额持有人利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。</p> <p><b>根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 因此, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。</b></p>
(三) 估值对象	(三) 估值对象 基金依法拥有的股票、债券等 <b>有价证券</b> 。	<b>(四) 估值对象</b> 基金依法拥有的股票、债券等 <b>有价证券及其他资产</b> 。
(六) 暂停估值的情形	(六) 暂停估值的情形 1. 基金投资涉及的 <b>证券市场</b> 遇法定节假日或因其他原因停市时;	<b>(七) 暂停估值的情形</b> 1. 基金投资涉及的 <b>证券/期货市场</b> 遇法定节假日或因其他原因停市时;
(七) 特殊情形的处理	(七) 特殊情形的处理 1. 基金管理人或基金托管人按 <b>股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(2)项</b> 进行估值时, 所造成的误	<b>(八) 特殊情形的处理</b> 1. 基金管理人或基金托管人按 <b>估值方法的第9项</b> 进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

		<p>差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2.由于证券交易市场及登记结算机构发送的数据错误，或由于不可抗力，基金管理人和基金托管人已经采取必要、适当、合理的措施进行检查仍未能发现的错误造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要措施消除由此造成的影响。</p>	<p>2.由于证券/<b>期货</b>交易市场及登记结算机构发送的数据错误，或由于不可抗力，基金管理人和基金托管人已经采取必要、适当、合理的措施进行检查仍未能发现的错误造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要措施消除由此造成的影响。</p>
十九、基金的费用与税收	（一）基金费用的种类	<p>基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：</p> <p>.....</p> <p>4.证券交易费用；</p> <p>.....</p>	<p>基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：</p> <p>.....</p> <p>4.证券/<b>期货</b>交易费用；</p> <p>.....</p>
	（二）基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式	<p>.....</p> <p><b>3.基金管理人</b>和<b>基金托管人</b>可根据<b>基金规模等因素协商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。</b></p> <p>.....</p>	删除左侧内容。
二十、基金的收益与分配	（三）收益分配原则	<p>1.每份基金份额享有同等分配权。</p> <p><b>2.基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。</b></p> <p><b>3.如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。</b></p> <p>4.基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。</p> <p>5.在符合上述基金分红条件的前提下，本</p>	<p>1.每份基金份额享有同等分配权。</p> <p><b>2.基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。</b></p> <p><b>3.在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 2 次，若自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特</b></p>

		<p>基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 2 次，若自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配部分的 100%。</p> <p>6.本基金收益分配采取现金方式。</p> <p>7.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	<p>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基金份额净值低于面值。</p> <p>4.本基金收益分配采取现金方式。</p> <p>5.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
<p>二十二、基金的信息披露</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息</p>	<p>无右侧内容。</p>	<p><b>12. 投资股指期货的相关公告</b></p> <p>在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露的股指期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p><b>13. 投资期权的相关公告</b></p> <p>基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示期权交易对基金总体风险的影响等。</p> <p><b>14. 投资资产支持证券的相关公告</b></p> <p>在中期报告、年度报告等定期报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p>在季度报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p>

			<p><b>15. 参与融资及转融通证券出借业务的信息披露</b></p> <p>本基金参与融资及转融通证券出借业务的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资及转融通证券出借业务的交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。</p>
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	（一）基金合同的变更	修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会批准，自批准之日起生效。但因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。	修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过， <b>自表决通过之日起生效</b> 。但因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。
	（二）基金合同的终止	<p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <p>1.基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2.基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3.法律法规规定或经中国证监会批准的其他情况。</p> <p>基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。<b>自中国证监会对清算结</b></p>	<p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：</p> <p>1.基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2.基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3.法律法规规定<b>和</b>中国证监会<b>规定的</b>其他情况。</p> <p>基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。</p>

		<b>果批准并予以公告之日起，本基金合同终止。</b>	
	(三) 基金财产的清算	..... 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。	..... 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 <b>20</b> 年以上。
二十五、争议的处理		本基金合同受中华人民共和国法律管辖。 基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人事后没有达成书面仲裁协议的，可以向人民法院起诉。	<b>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，应通过友好协商解决。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，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。</b> <b>争议处理期间，各方当事人应恪守各自职责，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。</b> <b>本合同受中国法律管辖。</b>
二十六、基金合同的效力		(一) 基金合同是基金当事人之间的法律文件。基金合同在基金募集结束，达到本基金备案条件后，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。 ..... (三) 本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和中国银监会一式 2 份外，基金管理人和基金托管人分别持有 2 份，每份具有同等的法律效力。 .....	(一) 基金合同是基金当事人之间的法律文件。基金合同在基金募集结束，达到本基金备案条件后，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会 <b>备案</b> 并公告之日止。 ..... (三) 本基金合同正本一式 <b>6</b> 份，除上报 <b>有关监管机构</b> 一式 2 份外，基金管理人和基金托管人分别持有 2 份，每份具有同等的法律效力。 .....

