

**中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开  
中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会  
的第二次提示性公告**

中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）于 2018 年 7 月 27 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（[www.zofund.com](http://www.zofund.com)）发布了《中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

**一、会议基本情况**

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》和《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金管理人中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 8 月 10 日起，至 2018 年 8 月 27 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号东方汇经中心 5 层

联系人：杜鹏

联系电话：021—68609600—6102

请在信封表面注明：“中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

**二、会议审议事项**

《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改方案说明书》（见附件四）。

**三、基金份额持有人的权益登记日**

本次大会的权益登记日为 2018 年 8 月 9 日，即在 2018 年 8 月 9 日下午交易时间结束后，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加本次基金份额持有人大会。

#### 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（[www.zofund.com](http://www.zofund.com)）下载并打印表决票。

2、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）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（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）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（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单位公章（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，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）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件（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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（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，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（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）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的营业执照复印件（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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（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，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（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，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，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（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) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

3、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自 2018 年 8 月 10 日起，至 2018 年 8 月 27 日 17:00 以前（送达时间以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人办公地址，并请在信封表面注明：“中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号东方汇经中心 5 层

联系人：杜鹏

联系电话：021—68609600—6102

## 五、计票

1、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票人在基金托管人（兴业银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后第 2 个工作日进行计票，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，不影响计票和表决结果，基金管理人可授权三名监票人进行计票。

2、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达基金管理人的，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，或未能在规定时间之内送达基金管理人的，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，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面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(含 50%);

2、《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》应当由提交有效表决票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；

3、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提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定，并与登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自生效之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

## 七、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，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面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(含 50%)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，基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集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。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：中欧基金管理有限公司

联系人：曹野

联系电话：021-68609600-5118

传真：021-33830351

网址：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

2、监督人：兴业银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：021—62154848

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

## 九、重要提示

1、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。

2、本基金停牌时间为于基金份额持有人大会计票日（2018 年 8 月 29 日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-9700 咨询。

4、本公告的有关内容由中欧基金管理有限公司负责解释。

中欧基金管理有限公司

2018 年 7 月 31 日

附件一：《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》

附件二：《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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：《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改方案说明书》

附件一：

## 关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》和《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）有关规定，基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议对中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“中欧沪深 300”）进行转型，调整基金名称、基金运作方式、基金投资、基金费率、基金收益分配规则和基金份额净值的精度等内容。基金合同修改的具体内容详见附件四《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改方案说明书》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。并在实施转型前披露修改后的《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》等法律文件，基金管理人在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回的前提下，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、终止上市交易等事项的转型实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：中欧基金管理有限公司

2018 年 7 月 27 日

附件二：

中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）  
基金份额持有人大会通讯表决票

|                                               |    |    |    |
|-----------------------------------------------|----|----|----|
| 基金份额持有人姓名/名称：                                 |    |    |    |
| 基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照号）：                     |    |    |    |
| 基金份额持有人开放式基金账户/深圳证券账户号：                       |    |    |    |
| 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/营业执照号）：                    |    |    |    |
| 审议事项                                          | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》 |    |    |    |
| 基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章                         |    |    |    |
| 日期：        年        月        日                |    |    |    |

说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见；表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见；2、“开放式基金账户/深圳证券账户”，仅指持有本基金份额的开放式基金账户/深圳证券账户号，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，应当分别填写；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、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”；4、本表决票可从本基金管理人网站（[www.zofund.com](http://www.zofund.com)）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

## 授权委托书

兹全权委托先生 / 女士或单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2018 年 8 月 27 日的以通讯方式召开的中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人开放式基金账户/深圳证券账户号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

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、“开放式基金账户/深圳证券账户号”，仅指持有本基金份额的开放式基金账户/深圳证券账户号，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，应当分别填写；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：

## 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改方案说明书

### 一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》和《中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议关于中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案。

2、本次中欧沪深 300 基金合同修改方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，因此方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中欧沪深 300 持有人大会决议的备案，均不表明其对本次基金合同修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

### 二、调整方案要点

#### （一）变更基金名称

基金名称由“中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）”变更为“中欧互通精选混合型证券投资基金”。

#### （二）变更基金类别

由“股票型”变更为“混合型”。

#### （三）变更基金运作方式

由“上市契约型开放式”变更为“契约型开放式”。原有的上市基金份额终止上市交易。

#### （四）调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准和风险收益特征

调整了基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制和业绩比较基准，对基金合同的相应修改内容如下：

原文：

本基金采用指数增强型投资策略。以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

**拟修改为：**

在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

**原文：**

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中被动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的 80%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

**拟修改为：**

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、债券回购、同业存单、银行存款等货币市场工具、现金、衍生工具（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以参与融资交易。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

**原文：**

本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。

**1、资产配置策略**

本基金以追求基金资产收益长期稳定增长为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在股票、债券、权证和现金等各类资产之间进行适度主动投资的调配。

在资产配置类别上，本基金投资于股票资产的比例为 90%-95%，其中被动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的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 2、股票投资策略

本基金被动投资组合采用复制标的指数的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资依据国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素对指数标的成份股及备选成份股进行优化；同时，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数沪深 300 指数成份股及备选成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

### （1）股票投资组合的构建

#### 1）指数跟踪部分的构建策略

本基金在建仓期内，将按照沪深 300 指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在有效跟踪业绩比较基准的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。

#### 2）指数增强部分投资策略

##### ① 成份股及备选成份股的增强型策略

从定量分析和定性分析两个角度进行考察，依据行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行增强型配置。

由于沪深 300 指数成份股及备选成份股多为大盘蓝筹股，公司经营状况稳定，因而选择其中价值被低估的指数成份股及备选成份股进行个股增强型配置。在各行业内部根据成份股及备选成份股的价值因子的对比情况，将成份股及备选成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股及备选成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股及备选成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股及备选成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，有限度地增加价值被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限度地减少价值被高估的成份股及备选成份股的权重。

A.定量分析方面，主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选，超配上述三项指标的数值均较好的行业。

B.定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势，超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

##### ② 成份股及备选成份股以外的股票增强型策略

#### A.进行一级市场股票投资

本基金适当参与一级市场股票的投资，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

#### B.精选具有投资潜力的股票

本基金管理人的股票选择策略旨在通过依托专业的研究力量，综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法，以“自下而上”的方式遴选出估值合理，具有持续成长能力的股票，将其纳入投资组合，分享中国经济高速增长的收益，力争实现高于指数的投资收益和基金资产的稳定增值。

##### a. 行业精选

本基金依据行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业，在行业内部进行个股精选。

i.定量分析方面，主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选，超配上述三项指标的数值均较好的行业。

ii.定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，结合对我国行业周期轮动特征的考察，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势，超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。

##### b. 个股精选

本基金的非成份股选择策略旨在通过依托专业的研究力量，综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法，在精选的行业内部遴选出估值合理，具有持续成长能力的股票，将其纳入投资组合。选股程序包括历史财务数据数量选股和基本面选股。

##### i.历史财务数据数量选股

本基金将使用上市公司过往 3 年的历史财务数据，选取主营收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、总资产周转率、股息率 5 个具有代表性的指标，力图获得高质量的成长股。在以上指标的计算过程中，4 月底时使用年报数据；8 月底时，存量指标（如总资产）使用半年报数据，流量指标（如净利润）使用当年上半年与前一年后半年相加的数据。

##### ii.基本面选股

本基金对备选股票池的股票进行基本面分析，着重分析其成长性，将主要从短期业绩成长性、成长可持续性、公司治理、风险因素和投资价值五个方面来对上市公司进行综合分析。

最后，基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断，集合投研团队的集体智慧，对股票备选库中的股票做出合适的投资判断，重点选择那些具有持续成长能力的公司，并在其价值被市场低估时进行投资，追求有效控制跟踪误差条件下高于指数的投资收益。

#### （2）投资组合调整策略

本基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，力争使基金净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最小化。

本基金采用定期调整和不定期调整相结合的方法对投资组合进行跟踪调整。

1) 定期调整：本基金股票指数化投资组合将根据标的指数的调整规则和备选成份股票的预期调整，对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法，以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。

2) 不定期调整：

① 当成份股发生增发、送配等情况而影响其在指数中权重时，本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

② 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪业绩比较基准；

③ 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重构建投资组合时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

④ 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

### 3、跟踪误差调整策略

本基金以指数化投资为主，增强型投资为辅，为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金选择以跟踪偏离度为标准，对积极投资行为予以约束，以控制基金相对业绩比较基准的偏离风险。

本基金以日跟踪偏离度为测算基础，将该指标的最大容忍值设定为 0.5%，以每周为基金投资效益评价的单位时间，n 选定为 30 个交易日，计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当日）。如该指标接近或超过 0.5%，则基金经理必须通过归因分析，将跟踪误差分解，找出跟踪误差的来源。

如果跟踪误差源于积极投资的操作，则在适当时机进行必要的组合调整，以使跟踪偏离度回归到最大容忍值之内。当跟踪偏离度在最大容忍值之内时，由基金经理对最佳偏离度的选择做出判断。

综上所述，在本基金运作过程中，基金管理人将对指数基金的跟踪误差进行分析、计算和调整，具体措施如下：

(1) 确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；

(2) 计算跟踪误差及其相关指标的实际值：以每周为单位时间计算跟踪误差及其相关指标的具体指标值，如达到或超过预警阈值，就发出警戒信号，提示基金经理关注和调整；

(3) 将跟踪误差及其相关指标的实际值与控制目标值进行比较，若符合条件，则根据实际情况判断是否维持组

合；若不符合条件，则对投资组合进行调整。

#### 4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。债券投资的目的是保证基金资产流动性，在股票市场整体走势不看好的前提下，为本基金提供较为安全的投资渠道，从而有效利用基金资产、提高基金资产的投资收益。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### 拟修改为：

##### 1、资产配置策略

本基金将参照以 MSCI 中国 A 股国际通指数为主要标准配置基金资产，投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股的比重在 20 个交易日内不持续低于组合中股票市值的 70%。对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。

##### 2、股票投资策略

###### （1）A 股选股策略

基金管理人在资产配置的框架下，通过定量分析和定性分析，精选估值合理、核心竞争力明确且具有较高投资价值的 A 股标的以构建投资组合。本基金定量的分析，主要通过净资产收益率、经营性现金流等指标来衡量公司的基本面状况，判断公司的内在价值；并通过市盈率、市净率、动量情绪等指标来判断估值的合理性。在定量分析的基础上，本基金从竞争力、管理质量、增长潜力和公司治理四个方面来对上市公司进行综合定性分析。使得本基金能够更好的完成投资目标。

###### （2）港股通标的股票选股策略

考虑到港股市场投资标的主要特征，本基金主要从以下几个因素筛选港股通标的股票：

- 1) 公司治理因素：即治理结构与管理层，优选具有良好治理结构及优秀、诚信管理层的公司；
- 2) 行业因素：重点考察行业集中度及行业地位，看重公司是否具备独特的核心竞争优势（如产品优势、成本优势、技术优势）和定价能力；
- 3) 业绩因素：相比 A 股市场，港股市场历史更悠久，公司业绩更稳定，因此会更偏重于考量业绩的稳定性，关注公司的持续业绩表现，优选业绩稳定并持续、具备中长期持续增长能力的港股标的。

###### （3）股票组合波动率控制策略

本基金在构建投资组合的过程中，会以最小化组合波动率为优化目标，估计股票间的相关性和个股自身的特异性风险，在平衡配置行业权重、个股权重和风险暴露后，对个股的权重配置进行优化。

### 3、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

#### （1）久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

#### （2）期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

#### （3）类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

#### （4）个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

### 5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

### 7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

## 8、可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金可根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，参与可转债和可交换债券新券的申购。

## 9、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以减少交易成本和降低跟踪误差为主要目标，适当参与股票期权投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

## 10、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

### 原文：

#### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(5)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6)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%；

(7)本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中被动投资于标的指数—沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；

(8)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%；

(9)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%；

(10)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%；

(11)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%;

(12)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；

(13)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；

(14)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(15)保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

(16) 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；

(17) 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；

(18)本基金投资其它金融工具的，其它金融工具的投资限制按届时有效的规定执行并在招募说明书中列明。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。

除上述第（12）、（15）、（16）、（17）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

#### **拟修改为：**

##### **1、组合限制**

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股

合计计算), 不超过该证券的 10%;

(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(6) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

(8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(9) 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%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 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%;

(13) 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;

(14) 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;

(15) 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%; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(17) 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;

(18) 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;

(19) 本基金参与国债期货、股指期货交易, 需遵守下列投资比例限制:

- 1) 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%;
- 2) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;
- 3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;
- 4) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;
- 5) 本基金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%;

6) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%;

7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

8) 本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；

（20）本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本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%；

2) 本基金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；

3) 本基金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；

（21）本基金若参与融资的，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，不得超过基金资产的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（22）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。

除上述第（2）、（13）、（17）、（18）项外，因证券/期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

#### **原文：**

本基金采用股票加现金的混合形式作为业绩比较基准，其中股票部分比较基准采用沪深 300 指数收益率，现金部分比较基准采用税后银行活期存款利率。本基金定位为指数增强型基金，以股票投资为主，因此本基金的业绩比较基准具体如下：

业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）

**拟修改为：**

本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

**原文：**

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

**拟修改为：**

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险

**（五）调整基金的费率**

**原费率结构：**

管理费：1.00%

托管费：0.15%

指数许可使用费用：0.016%

场外申购费率：

| 单笔金额（M）         | 收费标准      |
|-----------------|-----------|
| M<50 万元         | 1.20%     |
| 50 万元≤M<100 万元  | 0.80%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.40%     |
| M≥500 万元        | 单笔 1000 元 |

场外赎回费率：

| 持有基金份额期限  | 收费标准  |
|-----------|-------|
| N<7 天     | 1.50% |
| 7 天≤N<1 年 | 0.50% |
| 1 年≤N<2 年 | 0.25% |
| N≥2 年     | 0     |

场内申购费率：

| 单笔金额（M） | 收费标准 |
|---------|------|
|---------|------|

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| M<50 万元         | 1.20%     |
| 50 万元≤M<100 万元  | 0.80%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.40%     |
| M≥500 万元        | 单笔 1000 元 |

场内赎回费率

|          |       |
|----------|-------|
| 持有基金份额期限 | 收费标准  |
| N<7 天    | 1.50% |
| N≥7      | 0.50% |

调整为：

管理费：1.50%

托管费：0.25%

场外申购费率：

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类和 E 类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 申购金额（M）         | 收费标准      |
| M<100 万元        | 0.15%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.10%     |
| M≥500 万元        | 每笔 1000 元 |

非养老金客户申购本基金 A 类和 E 类基金份额的申购费率见下表：

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 单笔金额（M）         | 收费标准      |
| M<100 万元        | 1.50%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 1.00%     |
| M≥500 万元        | 单笔 1000 元 |

场外赎回费率：

|               |       |
|---------------|-------|
| 持有基金份额期限      | 收费标准  |
| N<7 天         | 1.50% |
| 7 日≤N<30 日    | 0.75% |
| 30 日≤N<365 日  | 0.50% |
| 365 日≤N<730 日 | 0.25% |
| N≥730 日       | 0     |

场内申购费率：

| 单笔金额（M）         | 收费标准      |
|-----------------|-----------|
| M<100 万元        | 1.50%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 1.00%     |
| M≥500 万元        | 单笔 1000 元 |

场内赎回费率

| 持有基金份额期限 | 收费标准  |
|----------|-------|
| N<7 天    | 1.50% |
| N≥7      | 0.50% |

#### （六）调整收益分配方式

原文：

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
  - 2、在符合有关法律法规规定和基金合同约定的基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次分配比例不低于期末可供分配利润的 50%，且基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不超过 15 个工作日；
  - 3、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
  - 4、基金收益分配后各基金份额类别基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去该类基金份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
  - 5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；
  - 6、本基金场外认购、申购基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日该类别的基金份额净值自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；;基金份额持有人可对 A 类基金份额和 E 类基金份额分别选择不同的分红方式；
- 场内认购、申购和上市交易的基金份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
- 7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

拟修改为：

- 1、同一类别每份基金份额享有同等分配权；

2、本基金场外基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应基金份额类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场内基金份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### **（七）增加基金合同终止情形的约定**

##### **拟修改为：**

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 个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

#### **（八）其他相关事项的修改**

同时鉴于《基金合同》生效于新《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》实施前，《基金合同》的部分条款已经不能适应形势的需要，故本次《基金合同》在变更上述事项的同时，对其他部分条款按照现时有效的相关法律法规及中国证监会的有关规定一并进行修改。

#### **（九）本基金新修改的基金合同的生效**

基金份额持有人大会决议生效日起不少于二十个开放日后，新修改的基金合同正式生效，具体生效日期本基金管理人将另行公告。自新修改的基金合同生效日起，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）正式变更为中欧互通精选混合型证券投资基金，本基金基金合同当事人将按照《中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

#### **（十）选择期期间的相关安排**

1、为保护基金持有人利益，自基金份额持有人大会决议生效之日的下一工作日起，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）将进入选择期以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。选择期不少于二十个工作日，在选择期期间，基金份额持有人可以申请赎回，本基金将暂停日常申购、定投和转换转入业务。

2、基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实具体事项，并授权基金管理人可根据实际情

况做相应调整。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### （一）中欧沪深300基本情况

本基金经中国证监会《关于核准中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2010]588号)核准募集,《基金合同》于 2010 年 6 月 24 日正式生效,基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

#### （二）召开基金份额持有人大会的必要性

鉴于目前本基金的风险收益特征已经不能切合当前投资者需求,为维护基金份额持有人利益,使本基金的风格特征更加鲜明,更加有利于投资者把握配置需求。因此,本基金拟召开持有人大会,将本基金由指数增强型证券投资基金变更为混合型证券投资基金,基金名称相应变更为中欧互通精选混合型证券投资基金,原有的上市基金份额终止上市交易,并调整基金投资范围、投资策略、管理费率、托管费率、基金收益分配规则和基金份额净值的精度等内容。

#### （三）中欧沪深300基金合同修改的可行性

##### 1、法律可行性

根据《基金合同》约定,可以通过召开基金份额持有人大会的方式,转换基金运作方式、变更基金投资目标、投资范围或投资策略等对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求,基金份额持有人大会决议的特别决议,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。

因此,本基金《基金合同》的修改不存在法律方面的障碍。

##### 2、技术运作可行性

本次基金合同修改不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更,技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金合同修改的平稳过渡,本基金管理人与登记机构、证券交易所已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究,已经做好了基金合同修改的相关准备。

### 四、本基金基金合同修改的主要风险及预备措施

#### （一）预防基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险,基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,在履行相关程序后进行适当修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如基金合同修改方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的基金合同修改方案议案。

## （二）预防基金合同修改后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合同修改后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

## 五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人：中欧基金管理有限公司客服中心

联系电话：021-68609700

传真：021-33830351

网站：[www.zofund.com](http://www.zofund.com)

附表：基金合同修改对照表

| 章节<br>(以变更后的章节为准) | 基金合同原条款                                                                                                                                                                             | 变更注册后基金合同的条款                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称              | 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）                                                                                                                                                           | 中欧互通精选混合型证券投资基金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 全文                | 各章节中序号“(一)”修改为“一、”，“(二)”修改为“二、”，以此类推。                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 第一部分 前言           | (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则<br>《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)                                                                                                                                | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则<br>《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 第一部分 前言           | (三) 中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）<br>中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。<br><br>中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 | 三、中欧互通精选混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）变更注册而来。中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。<br><br>中国证监会对中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。<br><br>投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。 |
| 第一部分 前言           | (四) 基金管理人、基金托管人<br>……<br><br>基金合同应当适用《基金法》及相关法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致基金合同的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。                                           | 五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 第一部分 前言           | 无                                                                                                                                                                                   | 六、本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。<br><br>七、本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。             |

|         |                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                      |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |                                                                                                       | 八、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。                                                                                                                                                             |
| 第二部分 释义 | 1、基金或本基金：指中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）                                                                   | 1、基金或本基金：指中欧互通精选混合型证券投资基金，由中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）变更注册而来                                                                                                                                                                           |
| 第二部分 释义 | 7、基金份额发售公告：指《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）份额发售公告》                                                         | 无                                                                                                                                                                                                                                    |
| 第二部分 释义 | 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 | 8、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 |
| 第二部分 释义 | 10、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订                          | 9、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订                                                                                                                                                          |
| 第二部分 释义 | 12、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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                          | 11、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《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                                                                                                                                                      |
| 第二部分 释义 | 无                                                                                                     | 12、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票                                                                                                                                                 |
| 第二部分 释义 | 18、机构投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织                | 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织                                                                                                                                                         |
| 第二部分 释义 | 19、合格境外机构投资者：指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者                                                 | 19、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》及相关法律法规规定可以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                                                                                                                                                     |
| 第二部分 释义 | 20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称                                          | 20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称                                                                                                                                                                     |
| 第二部分 释义 | 22、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务                                | 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务                                                                                                                                                                            |
| 第二部分 释义 | 23、场外或柜台：指通过深圳证券交易所交易系统以外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所                                                    | 23、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回                                                                                                                                                                  |

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 第二部分 释义 | 24、场内或交易所：指通过深圳证券交易所会员单位并利用深圳证券交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所                                                                                                                                                                                                       | 24、场内：指通过深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额申购、赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 第二部分 释义 | 25、直销机构：指中欧基金管理有限公司<br>26、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构<br>27、销售机构：指直销机构、代销机构以及具有基金代销资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的会员单位，其中场外销售机构指直销机构和代销机构                                                                                                 | 25、销售机构：指中欧基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 第二部分 释义 | 28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等<br>29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和/或中欧基金管理有限公司<br>30、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和/或中欧基金管理有限公司基金注册登记系统<br>31、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统 | 26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等<br>27、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的 A 类基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，E 类基金份额登记机构为中欧基金管理有限公司<br>28、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和/或中欧基金管理有限公司登记结算系统<br>29、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统<br>30、场外份额：指登记在登记结算系统下的 A 类基金份额和 E 类基金份额<br>31、场内份额：指登记在证券登记系统下的 A 类基金份额 |
| 第二部分 释义 | 32、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户<br>33、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户                                                                                                                                                          | 32、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司/中欧基金管理有限公司注册的开放式基金账户、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户<br>33、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股账户或证券投资基金账户。基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户<br>34、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户                                                                                     |
| 第二部分 释义 | 34、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定                                                                                                                                                                                                                                                   | 35、基金合同生效日：指《中欧互通精选混合型证券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

|         |                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                 |
|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         | <p>及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>.....</p> <p>36、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月</p>                                                        | <p>投资基金基金合同》生效日</p>                                                                                                                                                             |
| 第二部分 释义 | <p>39、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日</p>                                                                                                                                  | <p>39、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日</p>                                                                                                                                   |
| 第二部分 释义 | <p>41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日</p> <p>42、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段</p>                                                                                                  | <p>41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时发布的公告为准）</p> <p>42、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段</p>                          |
| 第二部分 释义 | <p>43、《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》等相关业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守</p> | <p>43、《业务规则》：指《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》、《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金登记结算业务指引》、《深圳证券交易所开放式基金交易和申购赎回业务实施细则》等相关业务规则及其不时修订，由基金管理人和投资人共同遵守</p>                      |
| 第二部分 释义 | <p>44、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为</p> <p>46、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</p>                                                                                    | <p>45、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</p>                                                                                                                    |
| 第二部分 释义 | <p>47、基金份额的分类：指本基金根据注册登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值</p>                                                                                            | <p>46、基金份额的分类：指本基金根据登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值</p>                                                                                               |
| 第二部分 释义 | <p>48、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为</p>                                                               | <p>47、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为</p>                                                                                  |
| 第二部分 释义 | <p>49、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为</p> <p>50、跨系统转登记：指基金份额持有人将持有的基金份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记</p>              | <p>48、转托管：指系统内转托管和跨系统转托管的总称</p> <p>49、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在同一登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为</p> <p>50、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的 A 类基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转</p> |

|              |                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | 的行为。除非基金管理人另行公告，本基金不支持 E 类基金份额进行跨系统转登记                                                                                                                                                                                          | 托管的行为。除非基金管理人另行公告，本基金不支持 E 类基金份额进行跨系统转托管。                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 第二部分 释义      | <p>51、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式</p> <p>52、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%</p>                      | <p>51、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式</p> <p>52、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 10%</p>                                                                                       |
| 第二部分 释义      |                                                                                                                                                                                                                                 | 53、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待                                                                                                                                                                                |
| 第二部分 释义      | <p>60、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体</p> <p>61、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易</p> | <p>61、货币市场工具：指现金；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具</p> <p>62、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介</p> <p>63、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件</p> <p>以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以后修订后法律法规、业务规则为准。</p> |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>（一）基金的名称</p> <p>中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）</p>                                                                                                                                                                                | <p>一、基金名称</p> <p>中欧互通精选混合型证券投资基金</p>                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>（二）基金的类别</p> <p>股票型</p>                                                                                                                                                                                                      | <p>二、基金的类别</p> <p>混合型证券投资基金</p>                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>（三）基金的运作方式</p> <p>上市契约型开放式</p>                                                                                                                                                                                               | <p>三、基金的运作方式</p> <p>契约型开放式</p>                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>（四）基金的投资目标</p> <p>本基金采用指数增强型投资策略。以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。在对标的指数有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>                                                   | <p>四、基金的投资目标</p> <p>在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。</p>                                                                                                                                                                                                                               |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>（五）基金的最低募集份额总额和金额</p>                                                                                                                                                                                                        | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 本情况             | <p>基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。</p> <p>（六）基金份额面值和认购费用</p> <p>基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金的认购费率最高不超过 5%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 第三部分 基金的基本情况    | <p>（七）基金存续期限</p> <p>不定期</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <p>五、基金存续期限</p> <p>不定期</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 第三部分 基金的基本情况    | <p>（八）基金份额类别</p> <p>本基金根据注册登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；E 类基金份额的注册登记机构为中欧基金管理有限公司。</p> <p>本基金 A 类基金份额、E 类基金份额分别设置代码，A 类基金份额通过场外和场内两种方式销售，并在交易所上市交易（场内份额上市交易，场外份额不上市交易，下同），A 类基金份额持有人可进行跨系统转登记；E 类基金份额通过场外方式销售，不在交易所上市交易，E 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在《招募说明书》中公告。</p> <p>根据基金运作情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商一致后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者增加新的基金份额类别等，调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。</p> | <p>六、基金份额的类别</p> <p>本基金根据登记机构的不同，将基金份额分为不同的类别。登记机构为中国证券登记结算有限责任公司的，称为 A 类基金份额；登记机构为中欧基金管理有限公司的，称为 E 类基金份额</p> <p>本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额分别设置代码。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：</p> <p>计算日某类基金份额净值＝该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。</p> |
| 第四部分 基金的历史沿革与存续 | <p>四、基金份额的发售</p> <p>（一）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式</p> <p>募集期内，本基金在柜台（场外）和交易所（场内）同时发售。投资人可以通过基金管理人的直销网点、代销机构的营业网点及其他的合法方式在柜台（场外）认购本基金的基金份额，也可以通过基金管理人委托的深圳证券交易所具有代销资格的会员单位在交易所（场内）认购本基金的基金份额。</p> <p>3、发售对象</p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人</p>                                                                                                                                                                                                   | <p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p>一、本基金的历史沿革</p> <p>中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）经中国证监会《关于核准中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监许可[2010]588 号文）核准募集，基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。</p> <p>2018 年 X 月 XX 日，中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意将中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）由指数增强型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，基金名称相应变更为中欧互通精选混合</p>                                                                                    |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>（二）基金份额的场内、场外认购</p> <p>1、基金份额的场内认购</p> <p>本基金份额的场内认购采用份额认购方法，投资者认购基金份额采用全额缴款的认购方式。</p> <p>场内具有代销资格的会员单位可按照基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定投资者场内认购的发售费率，具体费率详见招募说明书的约定。认购金额和利息折算的份额计算公式在招募说明书中列示。</p> <p>认购款项在基金募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。</p> <p>2、基金份额的场外认购</p> <p>（1）认购费用</p> <p>本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。具体费率详见本基金的招募说明书。</p> <p>（2）募集期利息的处理方式</p> <p>认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息及利息折算的基金份额以登记结算机构的记录为准。</p> <p>（3）基金认购份额的计算</p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>（4）份额余额的处理方式</p> <p>认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，认购申请成功受理的确认以基金合同生效后登记结算机构的确认结果为准。</p> <p>（三）基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>3、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。</p> | <p>型证券投资基金，原有的上市基金份额终止上市交易，并调整基金投资目标、投资范围、投资策略、基金费率、基金收益分配规则等内容。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于2018年X月XX日为A类基金份额终止上市的权益登记日，自该权益登记日的次一工作日起，《中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同》生效。</p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>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个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开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> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                             |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>五、基金备案</p> <p>（一）基金备案的条件</p> <p>1、本基金募集期为自基金份额发售之日起至多不超过 3 个月，具体见招募说明书的规定。如基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，且基金募集达到：（1）基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元；（2）基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。</p> <p>2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。</p> <p>3、本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。</p> <p>（二）基金募集失败</p> <p>1、基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。</p> <p>2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p> <p>（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p> |                                                                                             |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>六、基金份额的上市交易、申购与赎回</p> <p>（一）基金份额的上市交易</p> <p>基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金 A 类份额的基金份额上市交易。本基金 A</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>基金合同生效后，投资者可通过场外、场内两种方式对 A 类基金份额进行申购与赎回，可通过场外方式申购与赎回 E 类基金份额。</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>类基金份额上市后，投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖本基金 A 类基金份额。本基金 E 类基金份额不在交易所上市交易。</p> <p>1、上市交易的地点<br/>深圳证券交易所。</p> <p>2、上市交易的时间<br/>本基金 A 类基金份额拟在基金合同生效后 3 个月内开始在深圳证券交易所上市交易。<br/>在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。</p> <p>3、上市交易的规则<br/>本基金 A 类基金份额的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>4、上市交易的费用<br/>本基金 A 类基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。</p> <p>5、上市交易的行情揭示<br/>本基金 A 类基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。</p> <p>6、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市<br/>本基金 A 类基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>7、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。</p> |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（二） 基金份额申购和赎回场所</p> <p>投资人可通过场外和场内两种方式申购与赎回 A 类基金份额；通过场外方式申购与赎回 E 类基金份额。本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类份额变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及其他场外销售机构的销售网点办理本基金的场外申购和赎回业务。</p> <p>基金投资人也可使用深圳证券账户，通过场内销售机构利用深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购和赎回业务。</p> <p>具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> | <p>（三） 基金份额申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日，具体办理时间为上海证券交易所、深圳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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，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。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。</p> | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准。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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，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介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告本基金办理申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。</p> |
| <p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> | <p>（四） 基金份额申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。</p> <p>基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有的基金份额在登记结算系统确认时间的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>4、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，当日的场内申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；</p> <p>5、基金投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中</p>                                                                                                                                                                                                       |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。</p> <p>基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（五） 基金份额申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。</p> <p>2、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。</p> <p>3、申购和赎回的款项支付</p> <p>申购采用全额缴款方式，若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人。</p> <p>投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> | <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生基金合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。</p> <p>销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。</p> |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（六） 基金份额申购和赎回的金额</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p> <p>5、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p> <p>5、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。</p> <p>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（七） 基金份额申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，场内申购的有效份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。场外申购的有效份额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费，其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p> <p>6、本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照</p> | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内分别公告。特殊情况下，基金管理人可与基金托管人、登记机构协商增加基金份额净值计算位数，以维护基金投资人利益。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、A 类基金份额和 E 类基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用按照法律法规规定的比例纳入基金财产，具体比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p> <p>8、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对存量份额持有人无实质不利影响的前提下，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并进行公告。</p> <p>9、办理 A 类基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新规定，按照新规定执行。如需相应修改基金合同的，此项修改无须召开基金份额持有人大会。</p>                       |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（八）拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请。此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运转；</p> <p>2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</p> <p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形；</p> <p>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；</p> <p>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限</p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运转。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请；当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>的；</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、8 项暂停申购情形时，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。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。</p> <p>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、9 项暂停申购情形之一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介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。此时，本基金的转出申请将按同样方式处理：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运转；</p> <p>2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；</p> <p>4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项的措施；</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理方法在后续开放日予以支付，但最长不超过 20 个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资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。</p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。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公告。</p> |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十）巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一工作日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。但对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将自动视为取消赎回，而不会延至以后的开放日做延期赎回处理。</p> <p>（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。</p> <p>（4）暂停赎回：连续 2 日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。</p> | <p>2、巨额赎回的场外处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。</p> <p>（4）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的场内处理方式</p> <p>巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。</p> <p>4、巨额赎回的公告</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。                                                                                                                                                                                                 |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。</p> <p>2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。</p> <p>3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。</p> <p>4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日各类基金份额的基金份额净值。</p> | <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的各类基金份额净值。</p>                                                                                                                   |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十二）基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>十一、基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p>                                                                                                                                         |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十三）基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。</p> <p>继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供</p>                                                                                                                                                       | <p>十二、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。</p> <p>继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十四） 系统内转托管</p> <p>1、系统内转托管是指基金持有人将持有的基金份额在同一注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。</p> <p>2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构（网点）时，应依照销售机构（网点）规定办理基金份额系统内转托管。</p> <p>3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，应办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>（十五）跨系统转登记</p> <p>1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。</p> <p>2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。</p> <p>3、场外 A 类基金份额的基金份额持有人可通过跨系统转登记业务将场外 A 类基金份额转登记到场内后进行上市交易，E 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。</p> | <p>十三、基金的转托管</p> <p>1、系统内转托管</p> <p>系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在同一登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。</p> <p>2、跨系统转托管</p> <p>跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的 A 类基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。除非基金管理人另行公告，本基金不支持 E 类基金份额进行跨系统转托管。</p> |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十六）定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>十四、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p>                                                                                                                                                    |
| 第五部分 基金份额的申购与赎回 | <p>（十七）基金的冻结和解冻</p> <p>基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>十五、基金份额的冻结和解冻</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p> <p>十六、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金</p>                                                            |

|                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</p> <p>十七、基金份额的折算</p> <p>基金管理人有权根据市场情况对本基金进行份额折算，折算前后基金份额持有人持有的基金资产不变。基金管理人将在份额折算前 3 个工作日就折算方案、折算时间等内容进行相应公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 第六部分 基金合同当事人及权利义务 | <p>七、基金合同当事人及权利义务</p> <p>（一）基金管理人</p> <p>名称：中欧基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层，上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 7 层</p> <p>邮政编码：200120</p> <p>法定代表人：窦玉明</p> <p>成立时间：2006 年 7 月 19 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2006]102 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.88 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>（二）基金托管人</p> <p>名称：兴业银行股份有限公司</p> <p>住所：福州市湖东路 154 号</p> <p>办公地址：福州市湖东路 154 号</p> <p>法定代表人：高建平</p> <p>成立时间：1988 年 8 月 22 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2005]74 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币 207.74 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；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；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。</p> | <p>第六部分 基金合同当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>名称：中欧基金管理有限公司</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层</p> <p>法定代表人：窦玉明</p> <p>设立日期：2006 年 7 月 19 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]102 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.88 亿元</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：021-68609600</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（1）依法募集资金；</p> <p>（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；</p> <p>（3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；</p> <p>（4）销售基金份额；</p> <p>（5）按照规定召集基金份额持有人大会；</p> <p>（6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</p> <p>（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；</p> <p>（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；</p> <p>（9）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；</p> <p>（10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；</p> <p>（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>（三）基金份额持有人</p> <p>投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>（四）基金管理人的权利</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>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；</li> <li>3、发售基金份额；</li> <li>4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</li> <li>5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，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；</li> <li>6、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；</li> <li>7、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；</li> <li>8、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；</li> <li>9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；</li> <li>10、选择、更换代销机构，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和检查；</li> <li>11、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；</li> <li>12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；</li> <li>13、依法召集基金份额持有人大会；</li> <li>14、法律法规和基金合同规定的其他权利。</li> </ol> <p>（五）基金管理人的义务</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的</p> | <p>（12）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；</p> <p>（13）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；</p> <p>（14）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；</p> <p>（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</p> <p>（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）依法募集资金，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申购、赎回和登记事宜；</p> <p>（2）办理基金备案手续；</p> <p>（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；</p> <p>（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；</p> <p>（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；</p> <p>（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；</p> <p>（7）依法接受基金托管人的监督；</p> <p>（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</p> <p>（10）编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>（11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；</p> <p>（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>义务为：</p> <p>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；</p> <p>2、办理基金备案手续；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；</p> <p>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；</p> <p>7、依法接受基金托管人的监督；</p> <p>8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；</p> <p>9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；</p> <p>10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</p> <p>11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</p> <p>12、编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金</p> | <p>(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；</p> <p>(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；</p> <p>(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件得到有关资料的复印件；</p> <p>(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；</p> <p>(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；</p> <p>(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；</p> <p>(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；</p> <p>(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；</p> <p>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(25) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(26) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：兴业银行股份有限公司</p> <p>住所：福建省福州市湖东路 154 号</p> <p>法定代表人：高建平</p> <p>成立时间：1988 年 8 月 22 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：207.74 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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；</p> <p>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；</p> <p>22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；</p> <p>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；</p> <p>24、执行生效的基金份额持有人大会决议；</p> <p>25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；</p> <p>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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；</p> <p>27、法律法规和基金合同规定的其他义务。</p> <p>（六）基金托管人的权利</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：</p> <p>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；</p> <p>2、监督基金管理人对本基金的投资运作；</p> <p>3、自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；</p> <p>4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；</p> <p>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；</p> <p>6、依法召集基金份额持有人大会；</p> <p>7、按规定取得基金份额持有人名册资料；</p> <p>8、法律法规和基金合同规定的其他权利。</p> <p>（七）基金托管人的义务</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：</p> <p>1、安全保管基金财产；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的</p> | <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号</p> <p>（二）基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>（1）自基金合同生效之日起，依法法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；</p> <p>（2）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；</p> <p>（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；</p> <p>（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；</p> <p>（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；</p> <p>（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；</p> <p>（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；</p> <p>（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；</p> <p>（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；</p> <p>（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；</p> <p>（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>重大合同及有关凭证；</p> <p>6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；</p> <p>13、按照规定监督基金管理人的投资运作；</p> <p>14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；</p> <p>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款项；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>21、执行生效的基金份额持有人大会决议；</p> <p>22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；</p> <p>23、建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>24、法律法规和基金合同规定的其他义务。</p> <p>（八）基金份额持有人的权利</p> <p>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：</p> <p>1、分享基金财产收益；</p> <p>2、参与分配清算后的剩余基金财产；</p> <p>3、依法申请赎回其持有的基金份额；</p> <p>4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；</p> | <p>以保密，不得向他人泄露；</p> <p>（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>（12）建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；</p> <p>（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；</p> <p>（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；</p> <p>（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；</p> <p>（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；</p> <p>（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；</p> <p>（19）因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>（20）按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p> <p>（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>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；</p> <p>6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；</p> <p>7、监督基金管理人的投资运作；</p> <p>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；</p> <p>9、法律法规和基金合同规定的其他权利。</p> <p>同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>（九）基金份额持有人的义务</p> <p>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：</p> <p>1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；</p> <p>2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>5、执行生效的基金份额持有人大会决议；</p> <p>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；</p> <p>7、法律法规和基金合同规定的其他义务。</p> <p>（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据</p> | <p>（1）分享基金财产收益；</p> <p>（2）参与分配清算后的剩余基金财产；</p> <p>（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；</p> <p>（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；</p> <p>（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；</p> <p>（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；</p> <p>（7）监督基金管理人的投资运作；</p> <p>（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；</p> <p>（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；</p> <p>（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；</p> <p>（4）缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p> <p>（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；</p> <p>（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；</p> <p>（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；</p> <p>（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。</p> |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>八、基金份额持有人大会</p> <p>（一）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具有同等的投票权。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>第七部分 基金份额持有人大会</p> <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>本基金份额持有人大会不设日常机构。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>（二）召开事由</p> <p>1、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：</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | <p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>（1）终止基金合同；</p> <p>（2）更换基金管理人；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>(1) 提前终止基金合同；</p> <p>(2) 转换基金运作方式；</p> <p>(3) 变更基金类别；</p> <p>(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；</p> <p>(5) 变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>(6) 更换基金管理人、基金托管人；</p> <p>(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；</p> <p>(8) 本基金与其他基金的合并；</p> <p>(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。</p> <p>2、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：</p> <p>(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；</p> <p>(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调低基金的赎回费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的基金份额类别的设置；</p> <p>(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；</p> <p>(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实质性变化；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> | <p>(3) 更换基金托管人；</p> <p>(4) 转换基金运作方式；</p> <p>(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>(6) 变更基金类别；</p> <p>(7) 本基金与其他基金的合并；</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>(9) 变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>(13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；</p> <p>(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整基金份额类别的设置；</p> <p>(3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记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；</p> <p>(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；</p> <p>(5) 按照法律法规和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> |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>(三) 召集人和召集方式</p> <p>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。</p> <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | <p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。</p> <p>2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。</p> <p>3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金</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。</p> <p>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 日向中国证监会备案。</p> <p>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。</p> | <p>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。</p> <p>4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p>5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。</p> <p>6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。</p> |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>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：</p> <p>（1）会议召开的时间、地点和出席方式；</p> <p>（2）会议拟审议的主要事项；</p> <p>（3）会议形式；</p> <p>（4）议事程序；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（7）表决方式；</p> <p>（8）会务常设联系人姓名、电话；</p> <p>（9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；</p>                                                                          | <p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：</p> <p>（1）会议召开的时间、地点和会议形式；</p> <p>（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；</p> <p>（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；</p> <p>（4）授权委托证明的内容要求（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；</p> <p>（5）会务常设联系人姓名及联系电话；</p> <p>（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；</p> <p>（7）召集人需要通知的其他事项。</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p>                                                                                                                                                                          |

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>(10) 召集人需要通知的其他事项。</p> <p>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书面表决方式，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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面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书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | <p>3、如召集人为基金管理人，还应另行书面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，则应另行书面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，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>(五) 基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>1、会议方式</p> <p>(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；</p> <p>(4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会召开基金份额持有人大会。</p> <p>2、召开基金份额持有人大会的条件</p> <p>(1) 现场开会方式</p> <p>在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：</p> <p>1) 对到会的基金份额持有人在权益登记日持有基金份额的统计显示，其所持有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）；</p> <p>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。</p> <p>(2) 通讯开会方式</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：</p> <p>1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2</p> | <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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。</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证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</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证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；</p> <p>(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效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）。</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> |

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>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”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；</p> <p>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书面表决意见，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；</p> <p>4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面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；</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，并与注册登记机构记录相符。</p> | <p>(1) 会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；</p> <p>(3) 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（含三分之一）以上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>(4) 上述第（3）项中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。</p> <p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p> <p>4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。</p> |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>(六) 议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>                                                                                                                                                                       | <p>五、议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。</p> <p>基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(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：</p> <p>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进行解释和说明。</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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 30 日前公告。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。</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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> | <p>开前及时公告。</p> <p>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。</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七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。</p> <p>会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。</p> <p>(2) 通讯开会</p> <p>在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。</p> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>(2) 通讯方式开会</p> <p>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。</p> <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>(七) 决议形成的条件、表决方式、程序</p> <p>1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。</p> <p>2、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</p> <p>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；</p> <p>(2) 特别决议</p> <p>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、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>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。</p> | <p>六、表决</p> <p>基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。</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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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。</p> <p>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，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。</p> <p>基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p> <p>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。</p> |
| 第七部分 基金份额持有人大会 | <p>(八) 计票</p> <p>1、现场开会</p> <p>(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</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>七、计票</p> <p>1、现场开会</p> <p>(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                          | <p>人或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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>2、通讯方式开会</p> <p>在通讯方式开会的情况下，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。</p> | <p>持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。</p> <p>（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。</p> <p>（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。</p> <p>（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。</p> <p>2、通讯开会</p> <p>在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p> |
| 第七部分 基金份额持有人大会           | <p>（九）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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。</p> <p>（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。</p>                                                       | <p>八、生效与公告</p> <p>基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。</p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。</p> <p>基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。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。</p> <p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>                                    |
| 第八部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 | <p>九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>（一）基金管理人的更换</p> <p>1、基金管理人的更换条件</p> <p>有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>（1）基金管理人被依法取消基金管理资格；</p> <p>（2）基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>第八部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>（一） 基金管理人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>1、被依法取消基金管理资格；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；</p> <p>(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。</p> <p>2、基金管理人的更换程序</p> <p>更换基金管理人必须依照如下程序进行：</p> <p>(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名；</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；</p> <p>(3) 核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；</p> <p>(4) 交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金业务资料，及时办理基金业务移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；</p> <p>(5) 审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；</p> <p>(6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后 2 日内公告；</p> <p>(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。</p> <p>(二) 基金托管人的更换</p> <p>1、基金托管人的更换条件</p> <p>有下列情形之一的，基金托管人职责终止：</p> <p>(1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；</p> <p>(2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；</p> <p>(3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；</p> <p>(4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。</p> <p>2、基金托管人的更换程序</p> <p>(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名；</p> <p>(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；</p> | <p>2、被基金份额持有人大会解任；</p> <p>3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形。</p> <p>(二) 基金托管人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一的，基金托管人职责终止：</p> <p>1、被依法取消基金托管资格；</p> <p>2、被基金份额持有人大会解任；</p> <p>3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形。</p> <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>2、决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p> <p>3、临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；</p> <p>4、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>5、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 日内在指定媒介公告；</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金业务移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和基金资产净值；</p> <p>7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；</p> <p>8、基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。</p> <p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | <p>（3）核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；</p> <p>（4）交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；</p> <p>（5）审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；</p> <p>（6）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后 2 日内公告。</p> <p>（三）基金管理人与基金托管人同时更换</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p> <p>2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。</p> <p>（四）新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不出作出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。</p> | <p>2、决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p> <p>3、临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；</p> <p>6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和基金资产净值；</p> <p>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支。</p> <p>（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；</p> <p>2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；</p> <p>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。</p> |
| 第九部分 基金的托管   | <p>十、基金的托管</p> <p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>第九部分 基金的托管</p> <p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。</p> <p>订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 第十部分 基金份额的登记 | <p>（一）本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务。具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>一、基金份额的登记业务</p> <p>本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户/深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | 人名册等。                                                                                                                                                                                                                                                                         | 业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 第十部分 基金份额的登记 | （二）本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金份额持有人的合法权益。                                                                                                                                                    | 二、基金登记业务办理机构<br>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者开放式基金账户/深圳证券账户管理、基金份额登记、清算和结算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。                                                                                                                                                                          |
| 第十部分 基金份额的登记 | （三）注册登记机构享有如下权利：<br>1、建立和管理投资人基金账户；<br>2、取得注册登记费；<br>3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；<br>4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则；<br>5、法律法规规定的其他权利。                                                                                                                                    | 三、基金登记机构的权利<br>基金登记机构享有以下权利：<br>1、取得登记费；<br>2、建立和管理投资者开放式基金账户/深圳证券账户；<br>3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；<br>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；<br>5、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。                                                                                                                                                                            |
| 第十部分 基金份额的登记 | （四）注册登记机构承担如下义务：<br>1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；<br>2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；<br>3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上；<br>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；<br>5、按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；<br>6、接受基金管理人的监督；<br>7、法律法规规定的其他义务。 | 四、基金登记机构的义务<br>基金登记机构承担以下义务：<br>1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；<br>2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理本基金份额的登记业务；<br>3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；<br>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他情形除外；<br>5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；<br>6、接受基金管理人的监督；<br>7、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。 |
| 第十一部分 基金的投资  | （一）投资目标<br>本基金采用指数增强型投资策略。以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。在对标的指数有效                                                                                                                                                                                                                  | 一、投资目标<br>在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             | <p>跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>（二）投资范围</p> <p>本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中被动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的 80%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> | <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、债券回购、同业存单、银行存款等货币市场工具、现金、衍生工具（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金可以参与融资交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例为 60%－95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。权证投资占基金资产净值的比例为 0%－3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>（三）投资理念</p> <p>本基金通过将基本面分析与数量化投资技术相结合的指数增强型投资策略弥补纯指数化投资的缺陷，在有效控制与业绩比较基准的偏离风险的前提下力求取得高于标的指数的投资收益。本基金以指数化投资为主，辅以增强型投资策略，为投资者分享中国经济增长和中国证券市场发展带来的长期收益提供良好的机会。</p> <p>（四）投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数作为基金投资组合跟踪的标的指数。结合深入的基本面研究及</p>                                                                 | <p>三、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将参照以 MSCI 中国 A 股国际通指数为主要标准配置基金资产，投资于 MSCI 中国 A 股国际通指数成份股的比重在 20 个交易日内不持续低于组合中股票市值的 70%。对看好的部分行业适当增加投资，对看淡的行业适当减少投资。该“锁定基准，适当灵活”的强调纪律的投资风格有利于充分发挥本基金管理人的专业优势和团队优势；同时对行业投资比例增减的适度控制又可以减小本基金对市场基准的偏离，从而在适度风险基础上为投资人实现优厚的回报。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>数量化投资技术，在指数化投资的基础上对投资组合进行适度优化调整，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以追求基金资产收益长期稳定增长为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在股票、债券、权证和现金等各类资产之间进行适度主动投资的调配。</p> <p>在资产配置类别上，本基金投资于股票资产的比例为90%-95%，其中被动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的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金被动投资组合采用复制标的指数的方法进行组合构建，对于法律法规规定不能投资的股票挑选其它品种予以替代。主动投资依据国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性，综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素对指数标的成份股及备选成份股进行优化；同时，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选少数沪深300指数成份股及备选成份股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。</p> <p>（1）股票投资组合的构建</p> <p>1）指数跟踪部分的构建策略</p> <p>本基金在建仓期内，将按照沪深300指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在有效跟踪业绩比较基准的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。</p> <p>2）指数增强部分投资策略</p> <p>① 成份股及备选成份股的增强型策略</p> <p>从定量分析和定性分析两个角度进行考察，依据行业相对投资价值评估结果，精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行增强型配置。</p> <p>由于沪深300指数成份股及备选成份股多为大盘蓝筹股，公司经营状况稳定，因而选择其中价值被低估的指数成份股及备选成份股进行个股增强型配置。在各行各业内部根据成份股及备选成份股的价值因子的对比情况，将成份股及备选成份股分成三类——价值被低估的正超额收益预期的成份股及备选成份股、估值较合理的无超额收益预期的成份股及备选成份股以及价值被高估的负超额收益预期的成份股及备选成份股。在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，有限度地增加价值被低估的成份股及备选成份股的权重以及有限度地减少价值被</p> | <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）A股选股策略</p> <p>基金管理人在资产配置框架下，通过定量分析和定性分析，精选估值合理、核心竞争力明确且具有较高投资价值的A股标的以构建投资组合。本基金定量的分析，主要通过净资产收益率、经营性现金流等指标来衡量公司的基本面状况，判断公司的内在价值；并通过市盈率、市净率、动量情绪等指标来判断估值的合理性。在定量分析的基础上，本基金从竞争力、管理质量、增长潜力和公司治理四个方面来对上市公司进行综合定性分析。使得本基金能够更好的完成投资目标。</p> <p>（2）港股通标的股票选股策略</p> <p>考虑到港股市场投资标的主要特征，本基金主要从以下几个因素筛选港股通标的股票：</p> <p>1）公司治理因素：即治理结构与管理层，优选具有良好治理结构及优秀、诚信管理层的公司；</p> <p>2）行业因素：重点考察行业集中度及行业地位，看重公司是否具备独特的核心竞争优势（如产品优势、成本优势、技术优势）和定价能力；</p> <p>3）业绩因素：相比A股市场，港股市场历史更悠久，公司业绩更稳定，因此会更偏重于考量业绩的稳定性，关注公司的持续业绩表现，优选业绩稳定并持续、具备中长期持续增长能力的港股标的。</p> <p>（3）股票组合波动率控制策略</p> <p>本基金在构建投资组合的过程中，会以最小化组合波动率为优化目标，估计股票间的相关性和个股自身的特异性风险，在平衡配置行业权重、个股权重和风险暴露后，对个股的权重配置进行优化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。</p> <p>（1）久期偏离</p> <p>本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。</p> <p>（2）期限结构配置</p> <p>本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。</p> <p>（3）类属配置</p> <p>类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>高估的成份股及备选成份股的权重。</p> <p><b>A.定量分析方面</b>,主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选,超配上述三项指标的数值均较好的行业。</p> <p><b>B.定性分析方面</b>,以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础,结合对我国行业周期轮动特征的考察,从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势,超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。</p> <p>② 成份股及备选成份股以外的股票增强型策略</p> <p><b>A.进行一级市场股票投资</b></p> <p>本基金适当参与一级市场股票的投资,以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。</p> <p><b>B.精选具有投资潜力的股票</b></p> <p>本基金管理人的股票选择策略旨在通过依托专业的研究力量,综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法,以“自下而上”的方式遴选出估值合理,具有持续成长能力的股票,将其纳入投资组合,分享中国经济高速增长的收益,力争实现高于指数的投资收益和基金资产的稳定增值。</p> <p><b>a. 行业精选</b></p> <p>本基金依据行业相对投资价值评估结果,精选行业景气度趋于改善或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业,在行业内部进行个股精选。</p> <p><b>i.定量分析方面</b>,主要依据行业相对估值水平(行业估值/市场估值)、行业相对利润增长率(行业利润增长率/市场利润增长率)、行业 PEG(行业估值/行业利润增长率)三项指标进行筛选,超配上述三项指标的数值均较好的行业。</p> <p><b>ii.定性分析方面</b>,以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础,结合对我国行业周期轮动特征的考察,从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势,超配行业景气度趋于改善或者长期增长前景良好的优势行业。</p> <p><b>b. 个股精选</b></p> <p>本基金的非成份股选择策略旨在通过依托专业的研究力量,综合采用定量分析、定性分析和深入调查研究相结合的研究方法,在精选的行业内部遴选出估值</p> | <p>券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。</p> <p>(4) 个券选择</p> <p>个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的过程。</p> <p><b>4、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p><b>5、国债期货投资策略</b></p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,以套期保值为主要目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b></p> <p>本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。</p> <p><b>7、权证投资策略</b></p> <p>本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。</p> <p><b>8、可转换债券及可交换债券投资策略</b></p> <p>可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外,本基金可根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,参与可转债和可交换债券新券的申购。</p> <p><b>9、股票期权投资策略</b></p> <p>本基金将按照风险管理的原则,以减少交易成本和降低跟踪误差为主要目标,适当参与股票期权投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                           |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>合理，具有持续成长能力的股票，将其纳入投资组合。选股程序包括历史财务数据数量选股和基本面选股。</p> <p>i.历史财务数据数量选股</p> <p>本基金将使用上市公司过往 3 年的历史财务数据，选取主营收入增长率、净利润增长率、净资产收益率、总资产周转率、股息率 5 个具有代表性的指标，力图获得高质量的成长股。在以上指标的计算过程中，4 月底时使用年报数据；8 月底时，存量指标（如总资产）使用半年报数据，流量指标（如净利润）使用当年上半年与前一年后半年的数据相加的数据。</p> <p>ii.基本面选股</p> <p>本基金对备选股票池的股票进行基本面分析，着重分析其成长性，将主要从短期业绩成长性、成长可持续性、公司治理、风险因素和投资价值五个方面来对上市公司进行综合分析。</p> <p>最后，基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断，集合投研团队的集体智慧，对股票备选库中的股票做出合适的投资判断，重点选择那些具有持续成长能力的公司，并在其价值被市场低估时进行投资，追求有效控制跟踪误差条件下高于指数的投资收益。</p> <p>（2）投资组合调整策略</p> <p>本基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，力争使基金净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最小化。</p> <p>本基金采用定期调整和不定期调整相结合的方法对投资组合进行跟踪调整。</p> <p>1）定期调整：本基金股票指数化投资组合将根据标的指数的调整规则和备选成份股票的预期调整，对股票投资组合及时进行调整。本基金将合理把握组合调整的节奏和方法，以尽量降低因成份股调整对基金跟踪效果的影响。</p> <p>2）不定期调整：</p> <p>① 当成份股发生增发、送配等情况而影响其在指数中权重时，本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；</p> <p>② 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪业绩比较基准；</p> <p>③ 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重构建投资组合时，基金管理人将综合考虑跟</p> | <p>易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期货定价模型，选择估值合理的期权合约。</p> <p>10、融资投资策略</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金 将基于对市场行情和组合风险收益的的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
|  | <p>踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。</p> <p>④ 根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。</p> <p>3、跟踪误差调整策略</p> <p>本基金以指数化投资为主，增强型投资为辅，为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金选择以跟踪偏离度为标准，对积极投资行为予以约束，以控制基金相对业绩比较基准的偏离风险。</p> <p>本基金以日跟踪偏离度为测算基础，将该指标的最大容忍值设定为 0.5%，以每周为基金投资效益评价的单位时间，n 选定为 30 个交易日，计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当日）。如该指标接近或超过 0.5%，则基金经理必须通过归因分析，将跟踪误差分解，找出跟踪误差的来源。</p> <p>如果跟踪误差源于积极投资的操作，则在适当时机进行必要的组合调整，以使跟踪偏离度回归到最大容忍值之内。当跟踪偏离度在最大容忍值之内时，由基金经理对最佳偏离度的选择做出判断。</p> <p>综上所述，在本基金运作过程中，基金管理人将对指数基金的跟踪误差进行分析、计算和调整，具体措施如下：</p> <p>    (1)确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；</p> <p>    (2)计算跟踪误差及其相关指标的实际值：以每周为单位时间计算跟踪误差及其相关指标的具体指标值，如达到或超过预警阈值，就发出警戒信号，提示基金经理关注和调整；</p> <p>    (3)将跟踪误差及其相关指标的实际值与控制目标值进行比较，若符合条件，则根据实际情况判断是否维持组合；若不符合条件，则对投资组合进行调整。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。债券投资的目的是保证基金资产流动性，在股票市场整体走势不看好的前提下，为本基金提供较为安全的投资渠道，从而有效利用基金资产、提高基金资产的投资收益。</p> <p>在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金主动地增加预期利差将收窄</p> |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
|  | <p>的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>（五）投资决策</p> <p>1、投资决策依据</p> <p>投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。</p> <p>2、投资决策原则</p> <p>合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易，及严格控制。</p> <p>3、投资决策机制</p> <p>本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。</p> <p>其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，主要负责评价并批准不同基金的资产配置提案；协同风险控制委员会，审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险，并在必要时做出修改。</p> <p>投资总监全面负责公司基金投资管理业务，协调所有基金的投资活动，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。</p> <p>基金经理负责通过与研究部的通力合作，拟定资产配置提案提交投资决策委员会；并负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。</p> <p>4、投资决策程序</p> <p>本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：</p> <p>（1）投资决策委员会会议：为基金管理人的最高投资决策机构，由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。</p> <p>（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部对标的指数成份股和备选成份股，以及其他投资标的进行独立研究，并依据研究成果建立基金股票池。</p> <p>（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划。</p> <p>（4）投资组合管理会议：由投资总监主持，基金经理、研究部总监等参加。按照投资决策委员会会议决议，审查基金投资计划或基金资产配置和投资组合，分析基金投资风格和交易特征，并对基金投资计划提出建议。当会议对所议事项达成一致意见时，可形成</p> |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             | <p>决议。如果会议对所议事项不能达成一致意见，由投资总监做出最终决策或提交投资决策委员会讨论。</p> <p>(5) 基金经理根据投资决策委员会会议和投资组合管理会议的决议进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须从基金股票池中选择投资标的，并严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。</p> <p>(6) 中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。</p> <p>5、风险分析与绩效评估</p> <p>数量分析师负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。</p> <p>6、组合监控与调整</p> <p>基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及股票市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。</p>                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>(八) 投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(1)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(5)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(6)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%；</p> <p>(7)本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中被动投资于标的指数—沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1)本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；</p> <p>(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(7) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>80%;</p> <p>(8)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%;</p> <p>(9)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>(10)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>(11)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>(12)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;</p> <p>(13)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;</p> <p>(14)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;</p> <p>(15)保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>(16)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>(17)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>(18)本基金投资其它金融工具的,其它金融工具的投资限制按届时有效的规定执行并在招募说明书中列明。</p> <p>如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。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>除上述第(12)、(15)、(16)、(17)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基</p> | <p>不得超过该权证的 10%;</p> <p>(8)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;</p> <p>(9)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%;</p> <p>(10)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>(11)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>(12)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>(13)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;</p> <p>(14)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;</p> <p>(15)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%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;</p> <p>(16)本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;</p> <p>(17)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>(18)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>(19)本基金参与国债期货、股指期货交易,需遵守下列投资比例限制:</p> <p>1)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%;</p> <p>2)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;</p> <p>3)本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>4)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（7）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；</p> <p>（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；</p> <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>对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的沪深 300 指数成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行替代。</p> | <p>5）本基金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%；</p> <p>6）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；</p> <p>7）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>8）本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；</p> <p>（20）本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1）本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%；</p> <p>2）本基金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；</p> <p>3）本基金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>（21）本基金若参与融资的，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，不得超过基金资产的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>（22）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>除上述第（2）、（13）、（17）、（18）项外，因证券/期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <p>法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>（5）向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>（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；</p> <p>（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。</p> |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>（六）业绩比较基准</p> <p>本基金采用股票加现金的混合形式作为业绩比较基准，其中股票部分比较基准采用沪深 300 指数收益率，现金部分比较基准采用税后银行活期存款利率。本基金定位为指数增强型基金，以股票投资为主，因此本基金的业绩比较基准具体如下：</p> <p>业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）</p> <p>沪深 300 指数在 2005 年由中证指数有限公司编制，该公司是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同出资发起设立的一家专业从事证券指数及指数衍生产品开发服务的公司。</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，其样本股票经</p> | <p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：<b>MSCI 中国 A 股国际通指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%</b>。</p> <p><b>MSCI 中国 A 股国际通指数</b>是由明晟指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，<b>MSCI 中国 A 股国际通指数</b>旨在跟踪 <b>MSCI 新兴市场指数</b>关于中国 A 股的逐步纳入进程，指数使用基于在岸人民币汇率的中国 A 股计算。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数，其选择债券信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止 <b>MSCI 中国 A 股国际通指数</b>的编制、发布或授权，或 <b>MSCI 中国 A 股国际通指数</b>由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变</p>                                                                                                                                                                                                                                                      |

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             | <p>过流动性和财务稳定性的筛选，对沪深两市的覆盖率很高，并且不易被人为操纵，能较全面地描述 A 股市场的总体趋势，具有很强的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，采用了国际通用的自由流通量计算单只股票的权重，能更准确反映二级市场实际情况。同时，中证指数公司会根据具体情况的变化不定期的对指数样本和权重进行调整来更准确地反映市场状况。</p>                                                                                                                                                                                                                    | <p>更等事项导致 MSCI 中国 A 股国际通指数不宜继续作为基金的业绩比较基准，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在按照监管部门要求履行适当程序后，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。</p>                                                                                                                                                               |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>（七）风险收益特征</p> <p>本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 第十一部分 基金的投资 | <p>（九）基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</li> <li>2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；</li> <li>3、有利于基金财产的安全与增值；</li> <li>4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</li> </ol> <p>（十）基金的融资、融券</p> <p>本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。</p>                                                                                                              | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 第十二部分 基金的财产 | <p>（一）基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p> <p>（二）基金资产净值</p> <p>基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。</p> <p>（三）基金财产的账户</p> <p>本基金财产以基金托管人的名义开设基金银行账户（即基金托管专户）和证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p> <p>（四）基金财产的处分</p> <p>基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托</p> | <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。</p> <p>二、基金资产净值</p> <p>基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。</p> <p>三、基金财产的账户</p> <p>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p> <p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基</p> |

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | <p>管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。</p> <p>除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 第十三部分 基金资产估值 | <p>（一）估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>一、估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 第十二部分 基金的财产  | <p>（三）估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 第十三部分 基金资产估值 | <p>（二）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、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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>（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用</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、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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）交易所发行实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（3）交易所发行未实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全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，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券估值全价中所含的债券应</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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>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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</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（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>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，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>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。</p> <p>5、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。</p> <p>……</p> | <p>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，确定公允价值；</p> <p>（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</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、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</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估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>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，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。</p> <p>5、股指期货合约的估值方法</p> <p>（1）评估股指期货合约价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值。</p> <p>（2）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。</p> <p>6、国债期货合约以估值日的结算价估值。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。</p> <p>7、本基金投资股票期权合约，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。</p> <p>8、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。</p> <p>9、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；对第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>10、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>11、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。</p> <p>12、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p> <p>13、税收：对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。</p> <p>.....</p>                                                                                               |
| 第十二部分 基金的财产  | <p>（四）估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。本基金A类基金份额和E类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应当每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p>                                      | <p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。本基金A类基金份额和E类基金份额将分别计算基金份额净值。特殊情况下，基金管理人可与基金托管人、登记机构协商增加基金份额净值计算位数，以维护基金投资人利益。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。</p> |
| 第十三部分 基金资产估值 | <p>（五）估值错误的处理</p> <p>当基金份额净值（含各类基金份额的基金份额净值，下同）小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、差错类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行</p> | <p>五、估值错误的处理</p> <p>当基金份额净值（含各类基金份额的基金份额净值，下同）小数点后4位以内（含第4位）发生<u>估值错误</u>时，视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、估值错误类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。</p>                                                                                                    |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。</p> <p>由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p>2、差错处理原则</p> <p>（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。</p> <p>（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。</p> <p>（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。</p> <p>（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。</p> <p>（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承</p> | <p>2、估值错误处理原则</p> <p>（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。</p> <p>（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。</p> <p>（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | <p>担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。</p> <p>(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p>3、差错处理程序</p> <p>差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；</p> <p>(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；</p> <p>(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：</p> <p>(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p> <p>(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告。</p> <p>(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应当按照法律法规的规定向基金或基金份额持有人进行赔偿。</p> <p>(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。</p> <p>(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。</p> | <p>3、估值错误处理程序</p> <p>估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；</p> <p>(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p> <p>(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p> <p>(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p> <p>(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。</p> <p>(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p> |
| 第十三部分 基金资产估值 | <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>.....</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 第十三部分 基金资产估值 | <p>(七) 基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | 基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。本基金 A 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。                                                                                                                                                                                                        | 计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。                                                                                                                                                                                                                                 |
| 第十三部分 基金资产估值  | <p>（八）特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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>2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>                                                      | <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 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>2、由于不可抗力原因，或证券、期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>                                                                    |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>（一）基金费用的种类</p> <p>……</p> <p>3、基金财产拨划支付的银行费用；</p> <p>4、基金合同生效后的基金信息披露费用；</p> <p>……</p> <p>6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；</p> <p>7、基金的证券交易费用；</p> <p>8、基金上市费；</p> <p>9、指数许可使用费用；</p> <p>10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。</p>                                                                                      | <p>一、基金费用的种类</p> <p>……</p> <p>3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；</p> <p>4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；</p> <p>……</p> <p>6、基金的证券、期货交易费用；</p> <p>7、基金的银行汇划费用；</p> <p>8、基金的相关账户的开户及维护费用；</p> <p>9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</p> <p>10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p>                                                   |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p> | <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费</p>                                                                                                                                                             | <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费</p>                                                                                                                                                                             |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                   |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>                                                    |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>3、指数许可使用费用</p> <p>本基金管理人与指数许可方签订书面协议，约定指数许可使用的费用及支付方式。指数许可使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是基金管理人为获取指数许可方授予的使用指数开发基金的权利而支付的一次性费用，不列入基金费用；指数许可使用基点费是指基金设立后每个季度按照基金资产规模的一定比例收取的费用，列入基金费用。根据《中证指数有限公司指数使用许可协议》，在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。每日计算，逐日累计。</p> <p>计算方法如下：</p> $H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值。</p> <p>自基金合同生效日起，指数许可使用基点费每季度支付一次，指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元整（即不足 5 万元时按照 5 万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。</p> <p>4、除管理费、托管费和指数许可使用基点费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p> | <p>上述“一、基金费用的种类”中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>                                                                                                                     |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>（三）不列入基金费用的项目</p> <p>基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费、会计师费和指数许可使用固定费以及其他费用不从基金财产中支付。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <p>1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；</p> <p>2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；</p> <p>3、基金合同生效前的相关费用；</p> <p>4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。</p> |
| 第十四部分 基金费用与税收 | <p>（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                   |

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>（五）基金税收</p> <p>基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>四、基金税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 第十五部分 基金的收益与分配 | <p>（一）基金收益的构成</p> <p>1、买卖证券差价；</p> <p>2、基金投资所得红利、股息、债券利息；</p> <p>3、银行存款利息；</p> <p>4、已实现的其他合法收入；</p> <p>5、持有期间产生的公允价值变动。</p> <p>因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>一、基金利润的构成</p> <p>基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 第十五部分 基金的收益与分配 | <p>（二）基金期末可供分配利润</p> <p>基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算。基金期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <p>二、基金可供分配利润</p> <p>基金的收益分配比例以期末（收益分配基准日）可供分配利润为基准计算。基金期末可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 第十五部分 基金的收益与分配 | <p>（三）收益分配原则</p> <p>本基金收益分配应遵循下列原则：</p> <p>1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；</p> <p>2、在符合有关法律法规规定和基金合同约定的基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次分配比例不低于期末可供分配利润的 50%，且基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不超过 15 个工作日；</p> <p>3、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；</p> <p>4、基金收益分配后各基金份额类别基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去该类基金份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；</p> <p>6、本基金场外认购、申购基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日该类别的基金份额净值自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；；基金份额持有人可对 A 类基金份额和 E 类基金份额分别选择不同的分红方式；</p> <p>场内认购、申购和上市交易的基金份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</p> <p>7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</p> | <p>三、收益分配原则</p> <p>1、同一类别每份基金份额享有同等分配权；</p> <p>2、本基金场外基金份额的收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应基金份额类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p>场内基金份额的收益分配方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</p> <p>3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p>在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。</p> |

|                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 第十五部分 基金的收益与分配 | <p>（四）收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 第十五部分 基金的收益与分配 | <p>（五）收益分配的时间和程序</p> <p>1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；</p> <p>2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>五、收益分配的时间和程序</p> <p>1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案；</p> <p>2、基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 第十五部分 基金的收益与分配 | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>六、基金收益分配中发生的费用</p> <p>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 第十六部分 基金的会计与审计 | <p>（一）基金的会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的会计责任方；</p> <p>2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p> <p>3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；</p> <p>4、会计制度执行国家有关的会计制度；</p> <p>5、本基金独立建账、独立核算；</p> <p>6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；</p> <p>7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。</p> <p>（二）基金的审计</p> <p>1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。</p> <p>2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，经书面通知基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> | <p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p> <p>3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；</p> <p>4、会计制度执行国家有关会计制度；</p> <p>5、本基金独立建账、独立核算；</p> <p>6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。</p> <p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p> |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 第十七部分 基金的信息披露 | 基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。                                                                                                                                                                             | 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 第十七部分 基金的信息披露 | 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。                                                                                               | 二、信息披露义务人<br>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。<br>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。<br>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。                                                                                                                                  |
| 第十七部分 基金的信息披露 | 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；                                                                                                                                                                                                                      | 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：<br>4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 第十七部分 基金的信息披露 | 公开披露的基金信息包括：<br>（一）招募说明书<br>招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。<br>基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制基金招募说明书，并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。 | 五、公开披露的基金信息<br>公开披露的基金信息包括：<br>（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议<br>1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。<br>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。<br>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。 |
| 第十七部分 基金的信息披露 | （二）基金合同、托管协议<br>基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托                                                                                                                                                                                                                  | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。</p> <p>（三）基金份额发售公告</p> <p>基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。</p> <p>（四）基金合同生效公告</p> <p>基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。</p> <p>（五）基金份额上市交易公告书</p> <p>基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。</p>         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 第十七部分 基金的信息披露 | <p>（六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告</p> <p>1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值；</p> <p>2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值；</p> <p>3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在上列市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。</p> | <p>（二）基金资产净值、基金份额净值</p> <p>基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。</p> |
| 第十七部分 基金的信息披露 | <p>（七）基金份额申购、赎回价格公告</p> <p>基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明各类基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p>                                                                                                                                                                                                      | <p>（三）基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</p>                                                                                                                                                                                          |
| 第十七部分 基金的信息披露 | <p>（八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p> <p>1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；</p> <p>……</p> <p>4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会</p>                                                                                   | <p>（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>……</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会</p>                                                 |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。</p> <p>6、本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>7、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，……</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。如报告期内出现单一投资者持有基金份额数比例达到或超过基金份额总数 20%的情形……</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 第十七部分 基金的信息披露 | <p>（九）临时报告与公告</p> <p>在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开及决议；</p> <p>……</p> <p>7、基金募集期延长；</p> <p>8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；</p> <p>10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；</p> <p>11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；</p> <p>……</p> <p>17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.50%；</p> <p>18、基金改聘会计师事务所；</p> <p>19、基金变更、增加或减少代销机构；</p> <p>20、基金更换注册登记机构；</p> <p>……</p> <p>23、本基金发生巨额赎回并延期支付；</p> <p>……</p> <p>28、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。</p> | <p>（五）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开；</p> <p>……</p> <p>7、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>8、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；</p> <p>9、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；</p> <p>10、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p> <p>……</p> <p>16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>17、基金改聘会计师事务所；</p> <p>18、变更基金销售机构；</p> <p>19、更换基金登记机构；</p> <p>……</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>……</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>28、法律法规、中国证监会规定及本基金合同约定的其他事项。</p> |
| 第十七部分 基金的信息披露 | <p>（十）澄清公告</p> <p>在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>（十一）基金份额持有人大会决议</p> <p>（十二）中国证监会规定的其他信息</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>（六）澄清公告</p> <p>在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>（七）基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|  |                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。</p> <p>投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。</p> <p>本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。</p> | <p>监会备案，并予以公告。</p> <p>（八）股指期货的投资情况</p> <p>基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，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>（九）国债期货的投资情况</p> <p>基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对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>（十）股票期权的投资情况</p> <p>基金管理人应当在定期信息披露文件中披露参与股票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，并充分揭示股票期权交易对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。</p> <p>（十一）资产支持证券的投资情况</p> <p>本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其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。基金管理人应在基金季度报告中披露其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>（十二）港股通标的股票的投资情况</p> <p>基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。</p> <p>（十三）参与融资业务的信息披露</p> <p>基金管理人应在季度报告、半年度报告、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交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。</p> <p>（十四）中国证监会规定的其他信息。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。</p> |
| 第十八部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>（一）基金合同的变更</p> <p>1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的以下内容应经基金份额持有人大会决议同意。</p> <p>（1）转换基金运作方式；</p> <p>（2）变更基金类别；</p> <p>（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；</p> <p>（4）变更基金份额持有人大会程序；</p> <p>（5）更换基金管理人、基金托管人；</p> <p>（6）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提高该等报酬标准的除外；</p> <p>（7）本基金与其他基金的合并；</p> <p>（8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>（9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。</p> <p>但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：</p> <p>（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；</p> <p>（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调低基金的赎回费率或在对现有基金份额持有人利益无实</p> | <p>一、基金的合并</p> <p>本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。</p> <p>二、基金合同的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p> <p>2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。</p>                                                                                                                                                                                                                           |

|                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                | <p>质性不利影响的前提下调整本基金的基金份额类别的设置；</p> <p>（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；</p> <p>（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实质性变化；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。</p>                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 第十八部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>（二）本基金合同的终止</p> <p>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：</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；</p> <p>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；</p> <p>4、中国证监会规定的其他情况。</p>                                                                                                                                                      | <p>三、基金合同的终止事由</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 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、基金合同约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 第十八部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>（三）基金财产的清算</p> <p>1、基金财产清算组</p> <p>（1）自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算组，基金管理人组织基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>2、基金财产清算程序</p> <p>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：</p> <p>（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；</p> <p>（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；</p> | <p>四、基金财产的清算</p> <p>1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>4、基金财产清算程序：</p> <p>（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；</p> <p>（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；</p> <p>（3）对基金财产进行估值和变现；</p> <p>（4）制作清算报告；</p> <p>（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘</p> |

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|            | <p>(3) 对基金财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对基金财产进行估价和变现；</p> <p>(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；</p> <p>(6) 聘请律师事务所出具法律意见书；</p> <p>(7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；</p> <p>(8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；</p> <p>(9) 公布基金财产清算结果；</p> <p>(10) 对基金剩余财产进行分配。</p> <p>3、清算费用</p> <p>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。</p> <p>4、基金财产按下列顺序清偿：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 交纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿基金债务；</p> <p>(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p> <p>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。</p> <p>5、基金财产清算的公告</p> <p>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。</p> | <p>请律师事务所对清算报告出具法律意见书；</p> <p>(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；</p> <p>(7) 对基金剩余财产进行分配。</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月。</p> <p>五、清算费用</p> <p>清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金财产中支付。</p> <p>六、基金财产清算剩余资产的分配</p> <p>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p> <p>七、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p> |
| 第十九部分 违约责任 | <p>(一) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，……但是发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>……</p> <p>(二) 基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。</p> <p>(三) 本基金合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p> <p>(四) 因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。</p> <p>(五) ……但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>                                                                                                                                                                                                                          | <p>一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，……对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>……</p> <p>二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p> <p>三、……但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>                                                                                                                         |

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 第二十部分 争议的<br>处理和适用的法律 | <p>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上海分会，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。仲裁地点为上海市。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。</p> <p>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。</p> <p>本基金合同受中国法律管辖。</p>                                                                                                                    | <p>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，除经友好协商可以解决的，应提交上海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，仲裁的地点在上海市，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。</p> <p>争议处理期间，基金管理人、基金托管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。</p> <p>基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不含港澳台立法）管辖。</p>                                                                                                                                             |
| 第二十一部分 基金<br>合同的效力    | <p>基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>（一）本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，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备案并公告之日止。</p> <p>（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。</p> <p>（三）本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。</p> <p>（四）本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。</p> | <p>基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1、基金合同由《中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》修订而来，经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，并经基金管理人向中国证监会办理变更注册手续。</p> <p>2、基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>3、基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。</p> <p>4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p> <p>5、基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。</p> |
| 第二十二部分 其他<br>事项       | <p>本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |