

东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告

东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2018 年 5 月 11 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及基金管理人官网（www.scfund.com.cn）发布了《东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 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，现发布东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

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《东吴深证 100 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，东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金管理人东吴基金管理有限公司（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 5 月 12 日起，至 2018 年 6 月 7 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、会议计票日：2018 年 6 月 11 日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东源深路 279 号

邮编：200135

联系人：贾云鹏

联系电话：021-50509888 转 8111

请在信封表面注明：“东吴深证 100 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”。投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 4008210588 咨询。

二、会议审议事项

《关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》（见附件

一)。

上述议案的说明请参见《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 转型方案说明书》(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 5 月 11 日,即在 2018 年 5 月 11 日下午深圳证券交易所交易时间结束后,在中国证券登记结算有限责任公司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并投票表决

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、复印表决票或登录本基金管理人网站 (www.scfund.com.cn) 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经授权的业务公章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(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复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3) 个人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正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(可参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(4) 机构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企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可

使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,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企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5) 以上各项及本公告正文全文中的公章、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 5 月 12 日起,至 2018 年 6 月 7 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,请在信封表面注明:“东吴深证 100 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:东吴基金管理有限公司

办公地址:上海市浦东新区源深路 279 号

联系人:贾云鹏

联系电话:021-50509888 转 8111

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(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日后第 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。如基金托管人经通知但拒绝到场监督,不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的每份基金份额享有一票表决权。

3、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、本次会议召开的条件为：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；

2、《关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》须经前述参加大会的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50% 以上通过；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自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》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达到权益登记日基金总份额的 50% 以上方可举行。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，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定，基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但权益登记日仍为 2018 年 5 月 11 日。

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：东吴基金管理有限公司

联系人：贾云鹏

联系电话：021-50509888 转 8111

传真：021-50509884

网址：www.scfund.com.cn

邮编：200135

2、监督人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系方式：021-62154848

联系人：林奇

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 4008210588 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本基金首次停牌时间为本公告发布之日（2018 年 5 月 11 日）开市起至当日 10:30 停牌。本基金第二次停牌时间为基金份额持有人大会计票日（2018 年 6 月 11 日）开市起开始停牌至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

5、本公告的有关内容由东吴基金管理有限公司负责解释。

东吴基金管理有限公司

2018 年 5 月 14 日

附件一：《关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

附件二：《东吴深证 100 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：《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型方案说明书》

附件一：

关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型 有关事项的议案

东吴深证 100 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《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，对东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“东吴深证 100”）实施转型。具体安排可参见《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型方案说明书》见附件四。

为实施东吴深证 100 转型方案，提议授权基金管理人办理本次东吴深证 100 转型的有关具体事宜，并根据《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型方案说明书》对《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及相关法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

东吴基金管理有限公司

2018 年 5 月 14 日

附件二：

东吴深证 100 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/营业执照注册号）： | | | |
| 基金份额持有人基金账户号： | | | |
| 受托人（代理人）姓名/名称： | | | |
| 受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照注册号）： | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 《关于东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》 | | | |
| 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、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额；3、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；如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内送达基金管理人的，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、本表决票可从本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）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 6 月 7 日的以通讯方式召开的东吴深证 100 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。

授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人基金账户号：

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、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型方案说明书

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《东吴深证100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中国建设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，审议关于东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“东吴深证100”）转型有关事项的议案。

2、本基金转型后，基金名称由“东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）”变更为“东吴沪深 300 指数型证券投资基金”，跟踪标的由深证 100 价格指数更换为沪深 300 指数，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。考虑到市场同类基金费率水平，本基金转型后基金管理费率做相应下调。

3、本次东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型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 50% 以上通过，因此转型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。

4、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。自东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）终止上市之日起，《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》生效，《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效。中国证监会对本次东吴深证 100 持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型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、转型方案要点

（一）增设 C 类基金份额

1、转型后的基金将基金份额分为 A 类、C 类两类，按照不同的费率结构收取相关费用：

（1）转型后，原东吴深证 100 基金份额全部自动划归为东吴沪深 300 指数型证券投资基金 A 类基金份额类别；

(2) 转型后，新增加东吴沪深 300 指数型证券投资基金 C 类基金份额类别。

2、转型后各类份额类别的费率结构如下：

(1) 申购费

转型后基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费。A 类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

转型后基金 A 类基金份额的申购费率如下：

| 申购金额 M（含申购费） | 申购费率 |
|---------------|----------|
| M<50 万 | 1.20% |
| 50 万≤M<200 万 | 0.80% |
| 200 万≤M<500 万 | 0.40% |
| M≥500 万 | 1000 元/笔 |

(2) 赎回费

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。基金管理人可以在不违反法律法规的情形下，确定赎回费用归入基金财产的比例，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

1) 转型后基金 A 类份额的赎回费率如下：

| 持有时间 T | 赎回费率 |
|--------------|-------|
| T<7 日 | 1.50% |
| 7 日≤T<30 日 | 0.75% |
| 30 日≤T<180 日 | 0.50% |
| T≥180 日 | 0 |

对持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资人收取的赎回费总额的 25%计入基金财产，未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

2) 本基金 C 类份额的赎回费率如下:

| 持有时间 T | 赎回费率 |
|------------|-------|
| T<7 日 | 1.50% |
| 7 日≤T<30 日 | 0.50% |
| T≥30 日 | 0 |

对持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费将全额计入基金财产;对持续持有期不少于 7 日的投资人收取的赎回费总额的 25%计入基金财产,未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金份额持有人持有的原登记在证券登记结算系统的份额,持有期限自重新确认登记之日起计算;基金份额持有人原登记在注册登记系统的份额,持有期限自其认购/申购东吴深证 100 份额确认之日起计算。

(二) 转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后,东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择(如赎回或者卖出),具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期期间,东吴深证 100 份额的申购赎回、跨系统转托管业务照常办理,不受影响。基金份额持有人在东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)正式实施转型前,可选择卖出东吴深证 100 份额或赎回东吴深证 100 份额,对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人,其持有的东吴深证 100 份额将于终止上市日进行转换,最终将转换为东吴沪深 300 指数型证券投资基金 A 类基金份额。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相关事项,并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整,以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

(三) 关于转型后场内基金份额后续安排

自《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》生效之日起,关闭场内赎回、场内份额的跨系统转托管业务,原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额,将转登记至本基金管理人开立的中登场外基金账户上,届时仍持有东吴沪深 300 指数型证券投资基金场内份额余额的投资人,需根据基金管理人届时发布的相关公告,

对其持有的基金份额进行重新确认与登记，此过程即为“确权”，确权完成后，基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。

（四）授权基金管理人修改基金合同等法律文件

除上述内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及转型后的东吴沪深 300 指数型证券投资基金的产品特征修订《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及相关法律文件的相关内容。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及转型后的东吴沪深 300 指数型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》及相关法律文件的相关内容。

（五）转型后《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）将自东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）终止上市之日转型为东吴沪深 300 指数型证券投资基金。

自东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）终止上市之日起，《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》生效，原《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基本情况

东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）根据【2011】年【8】月【12】日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监基金字【2011】【1278】号）的核准，进行募集。基金合同于2012年3月9日生效，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

（二）东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）转型并召开持有人大会的必要性

1、充分保护持有人利益

东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）规模已经低于5000万元。若任其清算，基金份额持有人则不仅要承担资产卖出变现的冲击成本，还要承担各项清算成本；若不进行转型，其过小的资产管理规模以及产品的管理费、托管费及指数使用费等诸多因素将影响投资

组合表现。

2、满足当今市场及投资者对基金资产配置的需求

市场上沪深300指数基金的发行数量及规模上最近几年都有显著增长，得到了投资者的广泛认同，因此我们认为转型后的基金将能够更好地满足当今市场及投资者对基金资产配置的需求。

（三）东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）转型的可行性

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，变更基金类别、基金投资目标、投资范围或投资策略以及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一般决议，经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上通过方为有效。

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

基金管理人拥有多年投资、运营、风控经验，相关系统不存在技术操作上的障碍。

另外本次转型不涉及基金管理人、基金托管人和注册登记机构的变更，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。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

（一）预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型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，在履行相关程序后对转型方案进行适当修订，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。

如转型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转型方案议案。

（二）预防基金转型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，避免基金转型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：东吴基金管理有限公司

联系电话：4008210588

传真：021-50509884

网站：www.scfund.com.cn

附件：基金合同修改对照表

| 章节 | 修改前表述 | 修改后表述 |
|----|--|---|
| 全文 | 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) | 东吴沪深 300 指数型证券投资基金 |
| 全文 | 媒体 | 媒介 |
| 前言 | (一)订立本基金合同的目的、依据和原则 2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、 <u>《证券投资基金运作管理办法》</u> (以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律、法规。 | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、 <u>《公开募集证券投资基金运作管理办法》</u> (以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律、法规。 |
| 前言 | (三) <u>东吴深证 100 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。</u> 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、 <u>东吴沪深 300 指数型证券投资基金</u> 由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)变更注册而来。中国证监会对 <u>东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)</u> 的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、 <u>市场前景</u> 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。 <u>增加：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。</u> |
| 前言 | | <u>增加：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。</u> <u>六、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。</u> |
| 释义 | 1.基金或本基金：指 <u>东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)</u> | 1、基金或本基金：指 <u>东吴沪深 300 指数型证券投资基金</u> ，由东吴深证 100 指数增 |

| | | |
|----|---|---|
| | | 强型证券投资基金（LOF）变更注册而来 |
| 释义 | 4.基金合同或本基金合同：指《 东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同 》及对本基金合同的任何有效修订和补充 | 4、基金合同或本基金合同：指《 东吴沪深300指数型证券投资基金基金合同 》及对本基金合同的任何有效修订和补充 |
| 释义 | 5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《 东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议 》及对该托管协议的任何有效修订和补充 | 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《 东吴沪深300指数型证券投资基金托管协议 》及对该托管协议的任何有效修订和补充 |
| 释义 | 6.招募说明书：指《 东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书 》及其定期的更新 | 6、招募说明书：指《 东吴沪深300指数型证券投资基金招募说明书 》及其定期的更新 |
| 释义 | 删除：7.基金份额发售公告：指《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》 | |
| 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 |
| 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 |
| 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 |
| 释义 | 18.机构投资者：指依法可以投资 开放式 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 | 17、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 |
| 释义 | 19.合格境外机构投资者：指符合 现实有效 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 | 18、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 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 |
| 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 | 21、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 |
| 释义 | 23.销售机构：指直销机构和代销机构 24.直销机构：指东吴基金管理有限公司 25.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 26.基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点 | 22、销售机构：指东吴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 |
| 释义 | 27. 注册 登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和 交收 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 | 23、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 |
| 释义 | 28. 注册 登记机构：指办理 注册 登记业务的机构。基金的 注册 登记机构为东吴基金管理有限公司或接受东吴基金管理有限公司委托代为办理 注册 登记业务的机构。 本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司 | 24、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东吴基金管理有限公司或接受东吴基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构 |
| 释义 | 29.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 | 25、基金账户：指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 |
| 释义 | 30.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 | 26、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 |
| 释义 | 31. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定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 | 27、 基金合同生效日：指《东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》生效日 |
| 释义 | 删除：33.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 | |
| 释义 | 36.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 | 31、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 |

| | | |
|----|---|--|
| 释义 | 39.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 | 34、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 |
| 释义 | 40.《业务规则》：指《东吴基金管理有限公司开放式基金业务规则》，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 | 35、《业务规则》：指《东吴基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守 |
| 释义 | 删除：41.认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为 | |
| 释义 | 43.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 | 37、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 |
| 释义 | 44.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 <u>其他基金基金份额的行为</u> | 38、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 |
| 释义 | 46.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 | 40、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、扣款金额及扣款方式，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 |
| 释义 | 删除：48.上市交易：基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为 49.场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回 50.场内：通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回 51.注册登记系统：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 52.证券登记结算系统：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 53.场外份额：登记在注册登记系统下的基 | 增加：48、A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别 49、C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别 50、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产。如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对上述流动性受限资产范围进行调整 51、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 |

| | | |
|---------|--|---|
| | <p><u>金份额</u></p> <p><u>54.场内份额：登记在证券登记结算系统下的基金份额</u></p> <p><u>55.系统内转托管：基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为</u></p> <p><u>56.跨系统转登记：基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为</u></p> <p><u>57.深证 100 价格指数：由深圳证券信息有限公司编制并发布，该指数选取在深圳证券交易所中上市的 100 只 A 股作为成份股，采用派氏加权法编制。</u></p> <p>64.流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p> | <p>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</p> |
| 释义 | <p>66.不可抗力：指本基金合同当事人<u>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</u></p> | <p>53、不可抗力：指本基金合同当事人<u>不能预见、不能避免且不能克服的客观事件</u></p> |
| 基金的基本情况 | <p>(一)基金<u>的名称</u></p> <p><u>东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF)</u></p> | <p>一、基金名称</p> <p><u>东吴沪深 300 指数型证券投资基金</u></p> |
| 基金的基本情况 | <p>(三)基金的运作方式</p> <p><u>上市</u>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> |
| 基金的基本情况 | <p>(四)基金的投资目标</p> <p><u>删除：本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，</u></p> | <p>四、基金的投资目标</p> <p><u>增加：本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份</u></p> |

| | | |
|---------|---|---|
| 况 | <p>通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。</p> | <p>额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。</p> |
| 基金的基本情况 | <p>(五)标的指数 本基金的标的指数是深证100价格指数。如果标的指数被停止编制及发布,或标的指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后,依法变更本基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。 由于上述原因变更标的指数和投资对象,基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准,并在指定媒体上公告。</p> | <p>五、标的指数 沪深300指数</p> |
| 基金的基本情况 | <p>删除：(六)基金的最低募集份额总额和金额 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。 (七)基金份额面值和认购费用 基金份额的初始面值为人民币1.00元。 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> | <p>增加：七、基金份额的类别 本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。 本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为： 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。 投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不能互相转换。 本基金份额类别的具体设置、费率水平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、</p> |

| | | |
|------------------------|---|--|
| | | <p>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。上述调整不需要召开基金份额持有人大会。</p> |
| <p>基金份额的发售/基金的历史沿革</p> | <p>删除：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 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 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 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者和机构投资者以及合格境外机构投资者。</p> <p>(二)基金份额的认购</p> <p>1.基金份额的场内认购 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。 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。 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 本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率不得超过认购金额的5%。本基金的认购费率由基金管理</p> | <p>增加：第四部分 基金的历史沿革</p> <p>东吴沪深300指数型证券投资基金由东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)变更注册而来。</p> <p>东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)根据2011年8月12日中国证监会《关于同意东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可【2011】1278号)的核准，进行募集。募集结束后，基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》于2012年3月9日生效。基金管理人为东吴基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</p> <p>为了更好地满足投资者的需求，基金管理人将根据法律法规及《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，对东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)进行变更注册。</p> <p>****年**月**日，东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》，内容包括调整投资目标、投资范围、投资策略、投资组合比例并相应变更基金名称，变更基金份额持有人大会程序、基金合同当事人权利义务、估值方法、基金费用等事项并相应修改基金合同。自东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)终止上市之日起，《东吴沪深300指数型证券投资基金基金合同》生效，《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》自同一起失效。</p> |

| | | |
|------------|--|---|
| | <p>人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。</p> <p><u>(2) 募集期利息的处理方式</u> 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，其中利息以注册登记机构的记录为准。</p> <p><u>(3) 基金认购份额的计算</u> 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p><u>(4) 认购份额余额的处理方式</u> 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><u>(三)基金份额认购金额的限制</u></p> <p><u>1.投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> | |
| 基金备案/基金的存续 | <p><u>删除：五、基金备案</u></p> <p><u>(一)基金备案的条件</u></p> <p><u>1.本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，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，且基金募集达到基金备案条件，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。</u></p> <p><u>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。</u></p> | <p><u>增加：第五部分 基金的存续</u></p> <p><u>《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，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</u></p> <p><u>法律法规另有规定时，从其规定。</u></p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p><u>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。</u></p> <p><u>(二)基金募集失败</u></p> <p><u>1.基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</u></p> <p><u>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。</u></p> | |
| <p>基 金 份 额 的 上 市 交 易</p> | <p><u>删除：六、基金份额的上市交易</u></p> <p><u>本基金《基金合同》生效后，基金管理人将根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。</u></p> <p><u>(一)上市交易的地点</u></p> <p><u>深圳证券交易所。</u></p> <p><u>(二)上市交易的时间</u></p> <p><u>本基金《基金合同》生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。</u></p> <p><u>在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。</u></p> <p><u>(三)上市交易的规则</u></p> <p><u>本基金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。</u></p> | |

| | | |
|-------------------|--|---|
| | <p><u>(四) 上市交易的费用</u> <u>本基金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执行。</u></p> <p><u>(五) 上市交易的行情揭示</u> <u>本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值。</u></p> <p><u>(六) 上市交易的停复牌与暂停、终止上市</u> <u>本基金的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。</u></p> <p><u>(七) 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《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。</u></p> | |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p><u>(一) 申购和赎回场所</u> <u>删除：1.场内基金份额的申购与赎回场所</u> <u>有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见开放申购赎回公告）。</u> <u>2.场外基金份额的申购与赎回场所</u> 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点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<u>代销</u>机构，并予以公告。<u>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。</u></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。具体的销售网点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<u>销售</u>机构，并予以公告。基金<u>投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供其他方式办理基金份额</u>的申购与赎回。</p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p><u>(二) 申购和赎回的开放日及时间</u> <u>1. 开放日及开放时间</u> 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、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。<u>开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。</u> 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</p> | <p>二、 申购和赎回的开放日及时间 <u>1、 开放日及开放时间</u> 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、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。 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</p> |

| | | |
|-------------------|--|--|
| | <p>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 删除：基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 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基金份额申购、赎回的价格。</p> | <p>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>基金份额的申购与赎回</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. 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>删除：5.场内申购、赎回需遵守深圳证券交易所及登记结算公司场内业务有关规则。</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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人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>基金管理人可在法律法规允许的情况下，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> |
| <p>基金份额的申购与赎回</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>投资人在提交申购申请时须按销售机构</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>投资人在提交申购申请时须按销售机构</p> |

| | | |
|-------------------|---|--|
| | <p>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<u>注册</u>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<u>可在 T+2 日后(包括该日)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。基金销售机构对申购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。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。</u></p> <p>3. 申购和赎回的款项支付</p> <p><u>申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。</u></p> <p><u>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。</u></p> | <p>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>增加：2、申购和赎回的款项支付</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></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<u>有效</u>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<u>应在 T+2 日后(包括该日)及时</u>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。<u>若申购不成功，则申购款项退还给投资人。</u></p> <p><u>销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询。</u></p> <p><u>在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。</u></p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>(五)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</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<u>或相关公告。</u></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<u>或相关公告。</u></p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计</p> |

| | | |
|---------------------------|--|--|
| | <p>有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4.基金管理人可以<u>根据市场情况</u>，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<u>额</u>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<u>媒体</u>上公告并报中国证监会备案。</p> | <p>持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书<u>或相关公告</u>。</p> <p>5、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<u>额</u>等数量限制。基金管理人必须在调整<u>实施</u>前依照《信息披露办法》的有关规定在指定<u>媒介</u>上公告并报中国证监会备案。</p> |
| <p>基 金 份 额 的 申 购 与 赎回</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 <u>3 位</u>，小数点后第 <u>4 位</u>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。</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基金份额净值，有效份额单位为份。<u>通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，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者资金账户（返还资金的计算公式及方法见招募说明书）。通过场外方式申购的，申购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入</u>，由此产生的<u>误差计入</u>基金财产。</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>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 <u>4 位</u>，小数点后第 <u>5 位</u>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。</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 <u>A 类基金份额</u>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<u>该类</u>基金份额净值，有效份额单位为份，<u>上述计算结果均按四舍五入</u>方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的<u>收益或损失由基金财产承担</u>。</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》。<u>本基金的赎回费率由基金管理人决定，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，并在招募说明书中列示。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</u></p> |

| | | |
|------------|--|--|
| | <p>4. 申购费用由投资人承担，不列入基金财产，<u>主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。</u></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。<u>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 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</u></p> <p>6. <u>本基金的申购费率最高不超过申购金额的 1.2%，赎回费率最高不超过赎回金额的 1.5%。</u>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《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，<u>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。</u>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>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、<u>A 类基金份额</u>的申购费用由<u>申购 A 类基金份额</u>的投资人承担，不列入基金财产。<u>C 类基金份额不收取申购费用。</u></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<u>依照相关法律法规规定的比例归入基金财产，具体见招募说明书，未归入基金财产的赎回费用</u>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、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。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申购费率、赎回费率。</p> <p>增加：8、当发生大额申购赎回情形时，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> |
| 基金份额的申购与赎回 | <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人的申购申请：</p> <p>1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。</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人的申购申请：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>增加：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</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。 删除：3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</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>7. 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>8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述暂停申购情形时，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> | <p>投资人的申购申请。</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. 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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 增加：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>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、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>9、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，基金管理人暂停基金估值，并暂停接受基金申购申请。</p> <p>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、8、9、10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被全部或部分拒绝的，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> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 增加：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。</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>删除：4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p> <p>5. 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>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，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。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>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>增加：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、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，基金管理人暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>7、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接受赎回申请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，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> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>(九) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2. 巨额赎回的处理方式</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</p> | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</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</p> |

| | | |
|-------------------|--|--|
| | <p>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) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。</p> <p>(3)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>当发生上述延期赎回并延期办理时，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，同时在指定媒体上刊登公告。</p> | <p>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) 当基金发生巨额赎回时，如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。</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。</p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</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>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</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>2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。</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 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值。</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</p> |

| | | |
|------------|--|--|
| | 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 的基金份额净值。 | 赎回时,基金管理人应提前2日在指定 媒介 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 工作日 的 各类 基金份额净值。 |
| 基金份额的申购与赎回 | (十一)基金转换 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。 | 十一、基金转换 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。 |
| 基金份额的申购与赎回 | (十二)基金的非交易过户 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。 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 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。 | 十二、基金的非交易过户 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。 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。 |
| 基金份额的申购与赎回 | 删除: (十三)基金的转托管 本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照业务规则的有关规定以及基金代销机构的业务规则。 1、基金份额的登记 (1) 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结 | 增加: 十三、基金的转托管 基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。 |

| | | |
|------------|--|---|
| | <p>算系统基金份额持有人证券账户下。</p> <p><u>(2) 登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以申请场内赎回。</u></p> <p><u>(3) 登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回，不在深圳证券交易所上市交易，也不可以直接申请场内赎回。</u></p> <p>2、系统内转托管</p> <p><u>(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。</u></p> <p><u>(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</u></p> <p><u>(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，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</u></p> <p>3、跨系统转登记</p> <p><u>(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注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。</u></p> <p><u>(2) 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。</u></p> | |
| 基金份额的申购与赎回 | <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> |
| 基金份额的申购与赎回 | <p>(十五)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> |
| 基金 | | 增加：十六、基金份额的转让 |

| | | |
|--|--|---|
| 份 额 的 申 购 与 赎 回 | | 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管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。 |
| 基 金 合 同 当 事 人 及 权 利 义 务 | (一)基金管理人 <u>办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号</u> <u>邮政编码：200135</u> <u>成立时间：2004 年 9 月 2 日</u> 批准设立机关及批准设立文号：中国 <u>证券监督管理委员会</u> 证监基金字【2004】132 号 <u>存续期间：持续经营</u> | 一、基金管理人 <u>(一) 基金管理人简况</u> <u>设立日期：2004 年 9 月 2 日</u> 批准设立机关及批准设立文号：中国 <u>证监会</u> 证监基金字[2004]132 号 <u>存续期限：持续经营</u> <u>联系电话：021-50509888</u> |
| 基 金 合 同 当 事 人 及 权 利 义 务 | (四)基金管理人的权利 <u>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：</u> 1.自 <u>本基金合同</u> 生效之日起， <u>依照有关法律法规和本基金合同的规定</u> 独立运用基金财产； 2.依照 <u>基金合同</u> 获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入； 3. <u>发售</u> 基金份额； 13. <u>依法</u> 召集基金份额持有人大会； 6.根据 <u>本基金合同</u> 及有关规定监督基金托管人， <u>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</u> 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； 10.选择、更换 <u>代销机构</u> ，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查； <u>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；</u> | (二)基金管理人的权利与义务 <u>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：</u> <u>(1) 依法募集资金；</u> <u>(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；</u> <u>(3) 依照《基金合同》收取</u> 基金管理费以及法律法规规定或 <u>中国证监会</u> 批准的其他费用； <u>(4) 销售</u> 基金份额； <u>(5) 按照规定</u> 召集基金份额持有人大会； <u>(6) 依据《基金合同》及有关法律</u> 规定监督基金托管人， <u>如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；</u> <u>(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；</u> <u>(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；</u> <u>(10) 依据《基金合同》及有关法律</u> 规定 |

| | |
|---|---|
| <p><u>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；</u></p> <p>11.选择、更换律师、<u>审计师</u>、<u>证券经纪商</u>或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金<u>认购</u>、<u>申购</u>、<u>赎回</u>、<u>转换</u>、<u>非交易过户</u>、<u>转托管</u>等业务的规则，<u>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；</u></p> <p>14.法律法规和基金合同规定的其他权利。</p> <p><u>(五)基金管理人的义务</u> <u>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：</u></p> <p>1.依法募集<u>基金</u>，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<u>发售</u>、<u>申购</u>、<u>赎回</u>和登记事宜；</p> <p>3.自<u>基金合同</u>生效之日起，以诚实信用、勤勉<u>尽责</u>的原则管理和运用基金财产；</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》、<u>基金合同</u>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>8.计算并公告基金资产净值，确定基金份额<u>申购</u>、<u>赎回</u>价格；</p> <p>9.采取适当合理的措施使计算基金份额<u>认购</u>、<u>申购</u>、<u>赎回</u>和注销价格的方法符合<u>基金合同</u>等法律文件的规定；</p> <p>12.编制<u>中期</u>和年度基金报告；</p> <p>13.严格按照《基金法》、<u>基金合同</u>及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；</p> | <p><u>决定基金收益的分配方案；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、<u>会计师事务所</u>、<u>证券经纪商</u>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、<u>法规</u>的前提下，制订和调整有关基金<u>申购</u>、<u>赎回</u>、<u>转换</u>和<u>非交易过户</u>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><u>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：</u></p> <p>(1) 依法募集<u>资金</u>，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<u>申购</u>、<u>赎回</u>和登记事宜；</p> <p>(3) 自<u>《基金合同》</u>生效之日起，以诚实信用、<u>谨慎勤勉</u>的原则管理和运用基金财产；</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<u>基金</u>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》、<u>《基金合同》</u>及其他有关规定外，不得<u>利用基金财产</u>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>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<u>申购</u>、<u>赎回</u>和注销价格的方法符合<u>《基金合同》</u>等法律文件的规定，<u>按有关规定</u>计算并公告基金资产净值，确定基金份额<u>申购</u>、<u>赎回</u>的价格；</p> <p>(10) 编制<u>季度</u>、<u>半年度</u>和年度基金报告；</p> <p>(11) 严格按照《基金法》、<u>《基金合同》</u>及其他有关规定，履行信息披露及报告义</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》、<u>基金合同</u>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<u>基金合同</u>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》、<u>基金合同</u>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<u>记录、账册、报表</u>和其他相关资料；</p> <p>20.因违反<u>基金合同</u>导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；</p> <p>21.基金托管人违反<u>基金合同</u>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>24.执行生效的基金份额持有人大会决议；</p> <p>22.<u>按规定向基金托管人提供</u>基金份额持有人名册资料；</p> <p><u>25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；</u></p> <p><u>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；</u></p> | <p>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》、<u>基金合同</u>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>(13) 按<u>基金合同</u>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>(15) 依据《基金法》、<u>基金合同</u>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) <u>按规定</u>保存基金财产管理业务活动的<u>会计账册、报表、记录</u>和其他相关资料<u>15年以上</u>；</p> <p><u>(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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；</u></p> <p>(20) 因违反<u>基金合同</u>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) <u>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</u>，基金托管人违反<u>基金合同</u>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><u>(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；</u></p> <p>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(25) <u>建立并保存</u>基金份额持有人名册；</p> |
|--|---|

| | | |
|--------------|---|--|
| | 27.法律法规、中国证监会和 基金合同 规定的其他义务。 | (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。 |
| 基金合同当事人及权利义务 | <p>(二)基金托管人</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>成立时间：2004年9月17日</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务</p> <p>注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元</p> | <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>成立时间：2004年09月17日</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> |
| 基金合同当事人及权利义务 | <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>3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；</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>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>(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>(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</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>6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；</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>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、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</p> <p>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>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>13.按照规定监督基金管理人的投资运作；</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</p> | <p>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>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券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以保密，不得向他人泄露；</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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；</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、《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；</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</p> |
|--|--|

| | | |
|--------------|--|---|
| | <p>督管理机构，并通知基金管理人；</p> <p>17.因违反<u>基金合同</u>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<u>基金合同</u>造成基金财产损失时，应为<u>基金</u>向基金管理人追偿；</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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。</p> | <p>监管机构，并通知基金管理人；</p> <p>(19) 因违反<u>《基金合同》</u>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) 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<u>《基金合同》</u>造成基金财产损失时，应为<u>基金份额持有人利益</u>向基金管理人追偿；</p> <p>(22) 法律法规及中国证监会规定的和<u>《基金合同》</u>约定的其他义务。</p> |
| 基金合同当事人及权利义务 | <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<u>基金合同</u>当事人并不以在<u>基金合同</u>上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>(八)基金份额持有人的权利 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：</p> <p>4.按照规定要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>8.对基金管理人、基金托管人、基金<u>份额</u>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<u>基金合同</u>规定的其他权利。 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 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>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<u>《基金合同》</u>当事人并不以在<u>《基金合同》</u>上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>同一类别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>(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>(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<u>《基金合同》</u>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</p> |

| | | |
|-----------|---|--|
| | <p>2. <u>交纳基金认购、</u> 申购款项及法律法规和 <u>基金合同</u> 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 <u>基金合同</u> 终止的有限责任；</p> <p>4. 不从事任何有损基金及其他 <u>基金份额持有人</u> 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，<u>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</u> 处获得的不当得利；</p> <p>7. 法律法规和 <u>基金合同</u> 规定的其他义务。</p> <p><u>删除：(十)本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。</u></p> | <p><u>和履行义务；</u></p> <p>(4) <u>缴纳</u> 基金申购款项及法律法规和 <u>《基金合同》</u> 所规定的费用；</p> <p>(5) 在 <u>其</u> 持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者 <u>《基金合同》</u> 终止的有限责任；</p> <p>(6) 不从事任何有损基金及其他 <u>《基金合同》当事人</u> 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 <u>中国证监会</u> 规定的和 <u>《基金合同》</u> 约定的其他义务。</p> |
| 基金份额持有人大会 | <p>(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人 <u>或</u> 基金份额持有人的合法授权代表 <u>共同组成</u>。基金份额持有人持有的每一基金份额 <u>具有同等</u> 的投票权。</p> | <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人 <u>组成</u>，基金份额持有人的合法授权代表 <u>有权代表基金份额持有人出席会议并表决</u>。基金份额持有人持有的 <u>同一类别</u> 每一基金份额 <u>拥有平等</u> 的投票权。 <u>本基金份额持有人大会不设日常机构。</u></p> |
| 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，<u>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</u>，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 终止 <u>基金合同</u>；</p> <p>(6) <u>更换基金管理人、基金托管人</u>；</p> <p>(7) <u>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</u>；</p> <p>(4) 变更基金投资目标、<u>投资</u> 范围或 <u>投资</u> 策略；</p> | <p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>(1) 终止 <u>《基金合同》</u>；</p> <p>(2) <u>更换基金管理人</u>；</p> <p>(3) <u>更换基金托管人</u>；</p> <p>(5) <u>调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费，但法律法规要求调整报酬标准或提高销售服务费的除外</u>；</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>(10) <u>基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会</u>；</p> <p>(11) <u>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</u></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、<u>基金合同</u>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<u>基金合同</u>，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<u>费</u>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变更基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；</p> <p>(3)因相应的法律法规发生变动<u>必须</u>对<u>基金合同</u>进行修改；</p> <p><u>(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；</u></p> <p>(5)<u>基金合同</u>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<u>或本基金合同</u>规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p> | <p>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<u>基金份额持有人大会</u>；</p> <p>(12)对基金合同当事人权利和<u>义务</u>产生重大影响的其他事项；</p> <p>(13)法律法规、<u>《基金合同》</u>或中国证监会规定的其他<u>应当召开基金份额持有人大会的事项</u>。</p> <p>2、以下<u>情况</u>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)调低<u>除</u>基金管理费、基金托管<u>费</u>以外其他应由基金承担的费用；</p> <p>(2)<u>法律法规要求增加的基金费用的收取</u>；</p> <p>(3)<u>在不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整基金份额类别</u>；</p> <p>(4)因相应的法律法规发生变动<u>而应当</u>对<u>《基金合同》</u>进行修改；</p> <p>(5)<u>对《基金合同》</u>的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响<u>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</u>；</p> <p><u>(6)在不违反法律法规及基金合同规定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、销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则</u>；</p> <p><u>(7)在不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下推出新业务或服务</u>；</p> <p>(8)按照法律法规和<u>《基金合同》</u>规定不需召开基金份额持有人大会的<u>以外的</u>其他情形。</p> |
| <p>基金份额持有人大会</p> | <p>(三)召集人和召集方式</p> <p>1.除法律法规或<u>本基金合同</u>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<u>或者</u>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</p> | <p>二、<u>会议</u>召集人及召集方式</p> <p>1、除法律法规<u>规定</u>或<u>《基金合同》</u>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<u>或</u>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</p> |

| | | |
|------------------------|--|---|
| | <p>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<u>自行召集</u>。</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>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，<u>60 日内</u>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<u>由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</u></p> <p>4、代表基金份额 10% 以上（<u>含 10%</u>）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（<u>含 10%</u>）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（<u>含 10%</u>）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，<u>单独或合计</u>代表基金份额 10% 以上（<u>含 10%</u>）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>增加：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> |
| 基金 份 额 持 有 | (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 1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简 | 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 1、召开基金份额持有人大会，召集人应 |

| | | |
|--------------------------------------|---|--|
| <p>人大 会</p> | <p>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； (2)会议拟审议的主要事项； (3)会议形式； (4)议事程序； (5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日； (6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点； (7)表决方式； (8)会务常设联系人姓名、电话；</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>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； (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； (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>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>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书面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> |
| <p>基金 份额 持有 人大 会</p> | <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</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</p> |

| | |
|--|--|
| <p>力。</p> <p>(3) <u>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。</u></p> <p><u>删除：(4)会议的召开方式由召集人确定。</u></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><u>在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：</u></p> <p><u>1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>(2)通讯开会方式</p> <p><u>在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：</u></p> | <p>列席的，不影响表决效力。<u>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：</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(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）。</u></p> <p><u>参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。</u></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。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(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</u></p> |
|--|--|

| | | |
|------------------|---|--|
| | <p>1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;</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>金总份额的二分之一(含二分之一);</p> <p>若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的基金份额低于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会,应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的基金份额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、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人大会可通过网络、电话或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,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行;基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。</p> |
| <p>基金份额持有人大会</p> | <p>(六)议事内容与程序</p> <p>1.议事内容及提案权</p> <p>删除: (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;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少35天前提提交召集人并由召集人公告。</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</p> | <p>五、议事内容与程序</p> <p>1、议事内容及提案权</p> <p>增加: 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><u>核：</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。</u></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<u>注意事项</u>，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，<u>经合法执业的律师见证后形成大会决议。</u></p> <p><u>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</u></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<u>下列第七条</u>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，<u>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）</u></p> |
|--|--|

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

| | | |
|------------------|---|--|
| <p>基金份额持有人大会</p> | <p>(八)计票</p> <p>1.现场开会</p> <p>(1)如<u>基金份额持有人</u>大会由基金管理人或基金托管人召集，<u>则基金份额持有人大会</u>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<u>推举</u>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<u>推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。</u></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<u>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。</u></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<u>监票人在监督人派出的</u>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；<u>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。</u></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<u>选举</u>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<u>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</u>，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。<u>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。</u></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) <u>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。</u></p> <p><u>(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。</u></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<u>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）</u>的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。<u>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。</u></p> |
| <p>基金份额持有人大会</p> | <p>删除：(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><u>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</u></p> | <p>增加：八、生效与公告</p> <p><u>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。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</u></p> <p><u>基金份额持有人大会决议自生效之日起2</u></p> |

| | | |
|----------------------------|--|--|
| | <p>法核准或者出具无异议意见之日起生效。 <u>关于本章第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,关于本章第(二)条所规定的第(9)、(10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>(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。</u></p> | <p><u>个工作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。</u> <u>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。</u> <u>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,如与将来颁布的涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的,基金管理人应与基金托管人协商一致并提前公告后,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。</u></p> |
| <p>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> | <p><u>(一)基金管理人的更换</u> <u>1.基金管理人的更换条件</u> <u>(1)基金管理人</u>被依法取消基金管理资格; <u>(3)基金管理人</u>被基金份额持有人大会解任; <u>(2)基金管理人</u>依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产; <u>(4)法律法规和基金合同规定的</u>其他情形。 <u>(二)基金托管人的更换</u> <u>1.基金托管人的更换条件</u> <u>(1)基金托管人</u>被依法取消基金托管资格; <u>(3)基金托管人</u>被基金份额持有人大会解任; <u>(2)基金托管人</u>依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产; <u>(4)法律法规和基金合同规定的</u>其他情形。 <u>2.基金管理人的更换程序</u> <u>更换基金管理人必须依照如下程序进行:</u> <u>(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;</u> <u>(2)决议:基金份额持有人大会在<u>原</u>基金管</u></p> | <p><u>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</u> <u>(一)基金管理人职责终止的情形</u> 1、被依法取消基金管理资格; 2、被基金份额持有人大会解任; 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产; 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。 <u>(二)基金托管人职责终止的情形</u> 1、被依法取消基金托管资格; 2、被基金份额持有人大会解任; 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产; 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。 <u>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</u> <u>(一)基金管理人的更换程序</u> 1、提名:新任基金管理人由基金托管人或单独或合计持有 10%以上<u>(含 10%)</u>基金份额的基金份额持有人提名; 2、决议:基金份额持有人大会在基金管</p> |

| | |
|---|---|
| <p>理人职责终止后 6 个月内对被提名的<u>新任基金管理人</u>形成决议，<u>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；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>(6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在<u>新任基金管理人获得中国证监会核准后 2 日内公告；</u></p> <p>(4)交接：<u>原基金管理人</u>职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，<u>新任基金管理人或临时基金管理人</u>应当及时接收，<u>并与基金托管人核对基金资产总值；</u></p> <p>(5)审计：<u>原基金管理人</u>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，<u>审计费用在基金财产中列支；</u></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<u>任</u>基金管理人有关的名称字样。</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<u>原基金托管人</u>职责终止后 6 个月内对被提名的<u>新任基金托管人</u>形成决议，<u>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；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>(6)公告：基金托管人更换后，由基金管理</p> | <p>理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，<u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在<u>更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 个工作日内在指定媒介公告；</u></p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，<u>基金管理人</u>应妥善保管基金管理业务资料，及时<u>向临时基金管理人或新任基金管理人</u>办理基金管理业务的移交手续，<u>临时基金管理人或新任基金管理人</u>应及时接收。<u>新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；</u></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；</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<u>(含 10%)</u>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基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，<u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；</u></p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管</p> |
|---|---|

| | | |
|--------|---|---|
| | <p>人在<u>新任基金托管人获得中国证监会核准后2日内公告。</u></p> <p>(4)交接：<u>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；</u></p> <p>(5)审计：<u>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；</u></p> <p><u>(三)基金管理人</u>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>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<u>获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上联合公告。</u> 删除：(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，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。</p> | <p>理人在<u>更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告；</u></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。<u>新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值；</u></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。</p> <p><u>(三)基金管理人</u>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<u>(含10%)</u>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>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<u>生效后2个工作日内在指定媒介上联合公告。</u></p> |
| 基金托管 | <p><u>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《东吴深证100指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》。</u></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>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、<u>《基金合同》及其他</u>有关规定订立<u>托管协议。</u></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、<u>投资运作、净值计算、收益分配、信息披露</u>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> |
| 基金份额登记 | <p><u>(一)本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和交收业务，</u>具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额<u>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</u></p> | <p><u>一、基金份额的登记业务</u> <u>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，</u>具体内容包括投资人基金账户的<u>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、</u></p> |

| | | |
|---------|---|--|
| | 人名册等。 | 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。 |
| 基金份额的登记 | (二)本基金的 <u>注册</u> 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 <u>负责</u> 办理。基金管理人委托其他机构办理本基金 <u>注册</u> 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 <u>注册</u> 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、 <u>基金登记业务办理机构</u> 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 <u>投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜</u> 中的权利和 义务 ,保护基金份额持有人的合法权益。 |
| 基金份额的登记 | (三) <u>注册登记机构享有如下权利:</u> 2.取得 <u>注册</u> 登记费; 1.建立和管理 <u>投资人</u> 基金账户; 4.在法律法规允许的范围内, <u>制定和调整注册</u> 登记业务的相关规则; 5.法律法规规定的其他权利。 | 三、 <u>基金登记机构的权利</u> <u>基金登记机构享有以下权利:</u> 1、 <u>取得登记费;</u> 2、建立和管理 <u>投资者</u> 基金账户; 4、在法律法规允许的范围内, <u>对</u> 登记业务的 <u>办理时间</u> 进行调整,并依照有关规定于 <u>开始实施前在指定媒介上公告;</u> 5、法律法规及 <u>中国证监会</u> 规定的和 <u>《基金合同》</u> 约定的其他权利。 |
| 基金份额的登记 | (四) <u>注册登记机构承担如下义务:</u> 1.配备足够的专业人员办理本基金的 <u>注册</u> 登记业务; 2.严格按照法律法规和 <u>基金合同</u> 规定的条件办理基金的 <u>注册</u> 登记业务; 3.保存基金份额持有人名册及相关的 <u>申购、赎回业务记录 15 年以上;</u> 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 <u>投资人</u> 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; 5.按 <u>基金合同</u> 和招募说明书规定为 <u>投资人</u> 办理非交易过户等 业务 ,并提供其他必要服务; 7.法律法规规定的其他义务。 | 四、 <u>基金登记机构的义务</u> <u>基金登记机构承担以下义务:</u> 1、配备足够的专业人员办理本基金 <u>份额</u> 的登记业务; 2、严格按照法律法规和 <u>《基金合同》</u> 规定的条件办理本基金 <u>份额</u> 的登记业务; 3、 <u>妥善保存登记数据,并将</u> 基金份额持有人名称、身份信息及 <u>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;</u> 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 <u>投资者</u> 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 <u>法律法规及中国证监会</u> 规定的和 <u>《基金合同》</u> 约定的其他情形除外; 5、按 <u>《基金合同》</u> 及招募说明书规定为 <u>投资者</u> 办理非交易过户业务、提供其他必要的服务; 7、法律法规及 <u>中国证监会</u> 规定的和 <u>《基金合同》</u> 约定的其他义务。 |
| 基金 | 删除: (一)投资目标 | 增加: 一、投资目标 |

| | | |
|------------------|--|--|
| <p>的 投 资</p> | <p>本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。</p> <p>(二)投资范围</p> <p>本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及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>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>(三)投资策略</p> <p>本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证100价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为股票型指数增强基金，股票投资</p> | <p>本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。</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，以沪深300指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</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>本基金投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应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）或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>三、投资策略</p> <p>1、本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无</p> |
|------------------|--|--|

| | |
|--|---|
| <p>比例为基金资产的 90%-95%，其中深证 100 价格指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%。本基金还将根据投资研究团队对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，在本基金的投资范围内进行适度动态调整股票和债券等资产的配置比例，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据深证 100 价格指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整；同时，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，辅以量化增强策略等辅助增强策略，以期达到增强收益的目的。</p> <p>(1) 跟踪标的的选择</p> <p>本基金选择深证 100 价格指数作为跟踪标的指数。</p> <p>深证 100 价格指数由深圳证券信息有限公司编制并发布，该指数选取在深圳证券交易所中上市的 100 只 A 股作为成份股，采用派氏加权法编制，其成份股票代表了深圳市场中 A 股市场的核心优质资产，具有剪表性强、流动性高的特点，能够反映深圳 A 股市场的总体发展趋势。</p> <p>(2) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在初始建仓期或者为申购资金建仓时，按照深证 100 价格指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并进行适时调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>(3) 股票投资组合的调整</p> <p>①定期调整</p> <p>本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的深证 100 价格指数对其成份</p> | <p>法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>①当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；</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，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>③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他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的目的是在保证基金资</p> |
|--|---|

| | |
|--|--|
| <p>股的调整而进行相应的跟踪调整。</p> <p>②不定期调整 当深证 100 价格指数成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，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>③特殊情形下的调整 本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对目标指数中的成份股票加以替换，这些情形包括：a)法律法规的限制；b)目标指数成份股流动性严重不足；c)成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等。本基金进行替换遵循以下原则：a)用于替换的股票与被替换的股票属于同一行业，经营业务相似度高；b)用于替换的股票与被替换的股票的市场价格收益表现具有很强的相关性，能较好地代表被替换股票的收益表现；c)用于替换的股票优先从目标指数的其他成份股中挑选，如不能挑选出较合适的替换股票，再考虑从非目标指数成份股的股票中挑选。</p> <p>(4) 指数增强策略 本基金的增强型策略主要包括：成分股量化增强策略和非成分股增强策略。</p> <p>a) 成分股量化增强策略 本基金成分股量化增强策略采用东吴多因子量化增强策略，主要方法为选取价值、成长、盈利、市场特征四大类因子，建立 Alpha 多因子模型。大类因子由一系列单因子组成，其中价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平，包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA 等指标；成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预测增长；盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平；市场特征因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票的规模因子以及其他风格因子。上述因子能够综合反映股票市场的诸多驱动因素，能够寻找较好的投资机会。</p> | <p>产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。 基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>6、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进</p> |
|--|--|

| | |
|---|---|
| <p>通过东吴多因子量化增强策略，本基金对深证 100 价格指数成分股进行综合评分，并根据评分结果，在严格控制跟踪误差的前提下，对深证 100 价格指数成分股进行权重优化，作为指数增强投资中的参考。</p> <p>b) 非成分股增强策略</p> <p>对于非成分股的选择，本基金采用“东吴基金企业竞争优势评价体系”，即投研团队根据波特的五种竞争力模型，深入分析上市公司的战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势，采用定性的方法得到上市公司竞争优势的评价。本基金在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，适度投资于上述优选的非成分股上市公司股票，以期达到增强收益的目的。</p> <p>本基金还可投资预期将纳入指数的个股，以及新股发行、增发或配股在内的具有重大投资机会的股票，以增强基金的投资收益。</p> <p>(5) 跟踪误差控制</p> <p>本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>本基金将密切跟踪基金的实际跟踪误差，及时分析跟踪误差的来源，调整基金投资组合，将跟踪误差控制在跟踪目标以内。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资主要是流动性管理的需要，以获取适当收益。本基金采用自上而下的方式制定具体投资策略，考虑的主要因素是：宏观经济走势、资金供求状况、基础利率、债券收益率曲线、市场波动等。基金管理人将优先选择信用等级较高、剩余期限较短、流动性较好的政府债券进行投资，并通过对基金现金需求的科学分析，制定相应的债券投资策略，合理分配基金资产在债券上的配置比例。</p> <p>(四)业绩比较基准</p> <p>基金业绩比较基准=95%*深证 100 价格指数收益率 +5%*商业银行活期存款利率 (税后)</p> | <p>行定价。</p> <p>7、可转换债券/可交换债券投资策略</p> <p>可转换债券/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换券/可交换债券进行申购投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，制定相应的申购和择时卖出策略。</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) 本基金投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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）或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>(3) 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>(4) 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>(5) 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>(6) 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>(7) 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>(8) 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>(9) 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>(10) 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</p> |
|---|---|

| | |
|---|--|
| <p>深证 100 价格指数由深圳证券信息有限公司编制并发布，该指数选取在深圳证券交易所中上市的 100 只 A 股作为成份股，采用派氏加权法编制，其成份股票代表了深圳市场中 A 股市场的核心优质资产，具有代表性强、流动性高的特点，能够反映深圳 A 股市场的总体发展趋势。</p> <p>如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。</p> <p>(五)风险收益特征</p> <p>本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。</p> <p>(六)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基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(5)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>(6)本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例</p> | <p>发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(11)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>(12)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>(13)本基金仅在投资股指期货时，遵循以下限制：</p> <p>1)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)在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，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>3)在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4)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>5)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>(14)本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(15)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>(16)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</p> |
|---|--|

| | |
|---|---|
| <p>不低于 80%；</p> <p>(7)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>(8)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>(9)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>(10)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>(11)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>(12)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>(13)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>(14)保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>(15) 本基金管理人管理的全部开放式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>(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该基金资产净值的 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</p> | <p>一致；</p> <p>(17) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；</p> <p>(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第 (2)、(10)、(15)、(16) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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。如果法律法规对上述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，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。</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>如法律法规或监管部门取消上述限制，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。</p> |
|---|---|

| | |
|--|--|
| <p>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)本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。</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(11)、(14)、(16)、(17)项之外，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</p> | <p>3、关联交易原则</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者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>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准为：$\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$。</p> <p>沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，上海证券交易所和深圳证券交易所于2005年4月8日联合发布的反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数编制的目标是反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止沪深300指数的编制、发布或授权，或沪深300指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为沪深300指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持</p> |
|--|--|

| | | |
|------|--|--|
| | <p>规定禁止的其他活动； <u>(9)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。</u> <u>(七)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法</u> <u>1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；</u> <u>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；</u> <u>3.有利于基金财产的安全与增值；</u> <u>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。</u> <u>(八)基金的融资、融券</u> <u>本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。</u></p> | <p>有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。 <u>六、风险收益特征</u> <u>本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</u> <u>本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。</u> <u>七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法</u> <u>1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；</u> <u>2、有利于基金财产的安全与增值；</u> <u>3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</u> <u>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。</u></p> |
| 基金财产 | <p>(一)基金资产总值 基金资产总值是指<u>基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产</u>的价值总和。 (二)基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。 (三)基金财产的账户 <u>本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立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</u>登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。 (四)基金财产的处分 基金财产独立于基金管理人、基金托管人和<u>代销机构的固有财产</u>，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人<u>因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财</u></p> | <p>一、基金资产总值 基金资产总值是指<u>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</u>的价值总和。 二、基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去<u>基金</u>负债后的价值。 三、基金财产的账户 基金托管人<u>根据相关法律法规、规范性文件</u>为本基金<u>开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户</u>。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<u>基金</u>登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。 四、基金财产的<u>保管和处分</u> <u>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</u>，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、<u>基金</u>登记机构和基金销售机构以其自有的财</p> |

| | | |
|--------|---|--|
| | <p><u>产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托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。</u></p> <p>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。<u>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。</u></p> | <p><u>产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。</u></p> <p>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。<u>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。</u></p> |
| 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<u>正常营业</u>日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的<u>非营业</u>日。</p> <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>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<u>非交易日</u>。</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券、<u>股指期货合约</u>和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产<u>及负债</u>。</p> |
| 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><u>(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；</u></p> <p>(3)交易所上市未实行净价交易的<u>债券</u></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<u>或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的</u>，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<u>或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的</u>，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><u>(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本基金合同另有规定的除外），在估值日采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值；</u></p> <p>(3)交易所上市未实行净价交易的<u>可转</u></p> |

| | | |
|--------|---|--|
| | <p>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，按最近交易日的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>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>（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>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。</p> | <p>换债券，按估值日收盘价减去可转换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，按最近交易日的可转换债券收盘价减去可转换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>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>（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>增加：5、股指期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，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。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。</p> <p>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。</p> |
| 基金资产估值 | <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</p> | <p>四、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类</p> |

| | | |
|--------|---|--|
| | <p>额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后 第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2.基金管理人应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>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 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类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。</p> |
| 基金资产估值 | <p>(五)估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 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</p> | <p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，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>上述估值错误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。</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</p> |

| | |
|---|---|
| <p>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>删除：(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</p> | <p>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><u>法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。</u></p> <p><u>(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。</u></p> <p>3. <u>差错</u>处理程序</p> <p><u>差错</u>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<u>差错</u>发生的原因，列明所有的当事人，并根据<u>差错</u>发生的原因确定<u>差错</u>的责任方；</p> <p>(2)根据<u>差错</u>处理原则或当事人协商的方法对因<u>差错</u>造成的损失进行评估；</p> <p>(3)根据<u>差错</u>处理原则或当事人协商的方法由<u>差错</u>的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4)根据<u>差错</u>处理的方法，需要修改基金<u>注册</u>登记机构交易数据的，由基金<u>注册</u>登记机构进行更正，并就<u>差错</u>的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4.基金份额净值<u>差错</u>处理的<u>原则</u>和方法如下：</p> <p><u>删除：(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，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。</u></p> <p><u>(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。</u></p> | <p>3、<u>估值错误</u>处理程序</p> <p><u>估值错误</u>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<u>估值错误</u>发生的原因，列明所有的当事人，并根据<u>估值错误</u>发生的原因确定<u>估值错误</u>的责任方；</p> <p>(2)根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法对因<u>估值错误</u>造成的损失进行评估；</p> <p>(3)根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法由<u>估值错误</u>的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4)根据<u>估值错误</u>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<u>估值错误</u>的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值<u>估值错误</u>处理的方法如下：</p> |
| 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市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2.因不可抗力<u>或其它情形</u>致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3.<u>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；如出现会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急情况；</u></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、<u>期货</u>交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>4、<u>法律法规</u>或中国证监会<u>规定的</u>和基金合同认定的其它情形。</p> |

| | | |
|----------|---|--|
| 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。</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予以公布。</p> |
| 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6项进行估值时，所造成的误差不得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6项进行估值时，所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力，或由于证券、期货交易所及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应免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p> |
| 基金的费用和税收 | <p>(一)基金费用的种类</p> <p>4.基金合同生效后的基金信息披露费用；</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>3.基金财产拨划支付的银行费用；</p> <p>8.基金的开户费用、账户维护费用；</p> <p>9.基金上市费及年费；</p> <p>10.基金的指数使用费；</p> <p>11.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；</p> <p>12.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>3、C类基金份额的销售服务费；</p> <p>4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；</p> <p>5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；</p> <p>6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；</p> <p>8、基金的证券/期货交易费用；</p> <p>9、基金的银行汇划费用；</p> <p>10、基金账户开户费用、账户维护费用；</p> <p>11、基金财产投资运营过程中的增值税；</p> <p>12、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> |

| | | |
|----------|---|--|
| | (二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。 | |
| 基金的费用和税收 | <p>(三)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 <u>在通常情况下</u>，基金管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计提，按月支付。<u>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5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。</u></p> <p>2.基金托管人的托管费 <u>在通常情况下</u>，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： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值 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，<u>经基金托管人复核后于次月首日起5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。</u></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 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提，<u>逐日累计至每月月末，按月支付</u>，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5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、<u>公休假等</u>，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。<u>托管费</u>的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，<u>逐日累计至每月月末，按月支付</u>，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。<u>若遇法定节假日、公休日等</u>，支付日期顺延。</p> <p>增加：3、C类基金份额的销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.2%年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值 基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从</p> |

| | | |
|-----------------|--|--|
| | <p><u>删除：3、基金的指数使用费</u> <u>本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，且收取下限为每季度（《基金合同》生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限）人民币 5 万元。计算方法如下：</u> $H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日计提的指数使用费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值</u> <u>指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计。</u> <u>指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每季度结束后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。</u> <u>4.除管理费和托管费之外的基金费用，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。</u></p> | <p><u>基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</u> <u>4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费</u> <u>本基金指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。</u> <u>本基金指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二（2 个基点）的年费率计提。计算方法如下：</u> $H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的指数许可使用基点费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值</u> <u>指数许可使用基点费每日计提，逐日累计，按季支付。自基金合同生效日起，基金管理人、基金托管人和指数供应商核对一致后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内，按照确认的金额和指定的账户路径将上一季度的指数许可使用基点费从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。</u> <u>基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提方式进行合理变更并公告。标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数许可使用基点费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介上刊登公告。</u> <u>上述“一、基金费用的种类”中第 5—11 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。</u></p> |
| <p>基金的费用和税收</p> | <p>(四)不列入基金费用的项目 <u>删除：基金管理人</u>和<u>基金托管人</u>因<u>未履行或未完全履行义务</u>导致的<u>费用支出</u>或<u>基金财产的损失</u>，以及<u>处理与基金运作无关的事项</u>发生的<u>费用</u>等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师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 <u>增加：下列费用不列入基金费用：</u> <u>1、基金管理人</u>和<u>基金托管人</u>因<u>未履行或未完全履行义务</u>导致的<u>费用支出</u>或<u>基金财产的损失</u>； <u>2、基金管理人</u>和<u>基金托管人</u>处理与<u>基金运作无关的事项</u>发生的<u>费用</u>； <u>3、《基金合同》生效前的相关费用；</u></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。 |
| 基金的费用和税收 | <p><u>删除：(五)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。</u></p> <p><u>(六)基金税收</u> 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><u>增加：四、基金税收</u> 本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。</p> |
| 基金的收益分配 | <p>(三)收益分配原则</p> <p><u>删除：本基金收益分配应遵循下列原则：</u></p> <p><u>1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；</u></p> <p><u>2.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。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；</u></p> <p><u>3.本基金收益每年最多分配 8 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；</u></p> <p><u>4.若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；</u></p> <p>5.本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，<u>投资人</u>可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若<u>投资人</u>不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p><u>6.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；</u></p> <p>7. 基金收益分配后每一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>三、<u>基金</u>收益分配原则</p> <p>1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，<u>投资者</u>可选择现金红利或将现金红利自动转为<u>该类别</u>基金份额进行再投资；若<u>投资者</u>不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p>2、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><u>3、同一类别的基金份额享有同等分配权；</u></p> |

| | | |
|----------|---|---|
| | 8. 法律法规或监管 机构 另有规定的从其规定。 | 4. 法律法规或监管 机关 另有规定的，从其规定。 |
| 基金的收益分配 | <p>删除：(四)收益分配方案 <u>基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。</u></p> <p>(五)收益分配的时间和程序 <u>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；</u> <u>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。</u></p> | <p>增加：四、收益分配方案 <u>基金收益分配方案中应载明截至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。</u></p> <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施 <u>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</u> <u>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。</u></p> <p>六、基金收益分配中发生的费用 <u>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足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该类别基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</u></p> |
| 基金的会计与审计 | <p>(一)基金的会计政策 1.基金管理人为本基金的会计责任方； 2.本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日； 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； 4.会计制度执行国家有关的会计制度； 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； 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 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。<u>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。</u> 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>一、基金会计政策 1. 基金管理人为本基金的基金会计责任方； 2. 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； 3. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位； 4. 会计制度执行国家有关会计制度； 6. 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表； 7. 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。</p> <p>二、基金的年度审计 1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。 2. 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。</p> |

| | | |
|----------------|---|--|
| | <p>3.基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,经基金托管人(或基金管理人)同意,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>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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p> |
| <p>基金的信息披露</p> | <p>基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、<u>基金合同及其他有关规定</u>。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。</p> <p>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。<u>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。</u></p> <p>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:</p> <p>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;</p> | <p>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》、<u>《基金合同》</u>及其他有关规定。</p> <p><u>二、信息披露义务人</u></p> <p>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。<u>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</u></p> <p>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:</p> <p>4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;</p> |
| <p>基金的信息披露</p> | <p>公开披露的基金信息包括:</p> <p><u>删除:(一)招募说明书</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制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</u></p> | <p><u>五、公开披露的基金信息</u></p> <p>公开披露的基金信息包括:</p> <p><u>增加:(一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</u></p> <p><u>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者重大利益的事项的法律文件。</u></p> <p><u>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持</u></p> |

| | |
|--|--|
| <p>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。</p> <p>(二)基金合同、托管协议 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 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 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)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告 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基金份额净值； 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，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值； 3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。</p> <p>(六)基金份额申购、赎回价格公告 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>(七)基金年度报告、基金半年度报告、基</p> | <p>有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；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。</p> <p>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。</p> <p>(二)基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。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、各类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>(三)基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报</p> |
|--|--|

| | |
|--|---|
| <p>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>2.基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定报刊上;</p> <p>3.基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定报刊和网站上;</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.如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形, 为保障其他投资者利益, 基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</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.基金定期报告应当按有关规定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>(八)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>2.终止基金合同;</p> <p>7.基金募集期延长;</p> <p>9.基金管理人的董事在一年内变更超过</p> | <p>告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒介上。</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>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形, 为保障其他投资者利益, 基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>本基金持续运作过程中, 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。</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 个工作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>2、终止《基金合同》;</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>15、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;</p> |
|--|---|

| | | |
|---------|--|---|
| | <p>50%; 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>16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;</p> <p>17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;</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>23.本基金发生巨额赎回并延期支付;</p> <p>26.中国证监会或本基金合同规定的其他事项。</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>18、变更基金销售机构;</p> <p>19、更换基金登记机构;</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期办理;</p> <p>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p> <p>27、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。</p> |
| 基金的信息披露 | <p>(九)澄清公告 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)基金份额持有人大会决议 删除：(十一)中国证监会规定的其他信息 (十二)信息披露文件的存放与查阅 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。 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。 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>(六)澄清公告 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 增加：基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>(八)投资股指期货的信息披露 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)投资资产支持证券的信息披露 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) <u>中国证监会规定的其他信息。</u></p> <p><u>六、信息披露事务管理</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>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。</u> <u>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。</u></p> <p><u>七、信息披露文件的存放与查阅</u> <u>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。</u> <u>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。</u></p> |
| <p>基金合同的变更、终止与基金财产清算</p> | <p>(一)<u>基金合同的变更</u> <u>删除：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，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。</u> <u>(1)转换基金运作方式；</u> <u>(2)变更基金类别；</u> <u>(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；</u> <u>(4)变更基金份额持有人大会程序；</u></p> | <p><u>一、《基金合同》的变更</u> <u>增加：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。</u> <u>2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，并</u></p> |

| | | |
|--------------------------|---|--|
| | <p>(5)更换基金管理人、基金托管人； (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； (7)本基金与其他基金的合并； (8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项； (9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。 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： (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用； (2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率； (3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改； (4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化； (5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响； (6)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。 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> | <p>自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。</p> |
| <p>基金合同的变更、终止与基金财产清算</p> | <p>(二)本基金合同的终止 有下列情形之一的，<u>本基金合同经中国证监会核准后将终止</u>： <u>删除：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；</u> <u>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；</u> <u>4.中国证监会规定的其他情况。</u></p> | <p>二、<u>《基金合同》的终止事由</u> 有下列情形之一的，<u>《基金合同》应当终止</u>： <u>增加：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；</u> <u>3、《基金合同》约定的其他情形；</u> <u>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</u></p> |
| <p>基金合同</p> | <p>(三)基金财产的清算 1.基金财产清算组</p> | <p>三、基金财产的清算 <u>1、基金财产清算小组：自出现《基金合</u></p> |

| | | |
|-----------------------|---|---|
| <p>的变更、终止与基金财产的清算</p> | <p><u>(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。</u></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><u>删除：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：</u></p> <p><u>(1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；</u></p> <p><u>(2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；</u></p> <p><u>(3)对基金财产进行清理和确认；</u></p> <p><u>(4)对基金财产进行估价和变现；</u></p> <p><u>(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；</u></p> <p><u>(6)聘请律师事务所出具法律意见书；</u></p> <p><u>(7)将基金财产清算结果报告中国证监会；</u></p> <p><u>(8)参加与基金财产有关的民事诉讼；</u></p> <p><u>(9)公布基金财产清算结果；</u></p> <p><u>(10)对基金剩余财产进行分配。</u></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><u>删除：4.基金财产按下列顺序清偿：</u></p> <p><u>(1)支付清算费用；</u></p> <p><u>(2)交纳所欠税款；</u></p> <p><u>(3)清偿基金债务；</u></p> <p><u>(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</u></p> <p><u>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。</u></p> | <p><u>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。</u></p> <p>2、<u>基金财产清算小组组成：</u>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、<u>基金财产清算小组职责：基金财产清算小组</u>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><u>增加：(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；</u></p> <p><u>(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；</u></p> <p><u>(3)对基金财产进行估值和变现；</u></p> <p><u>(4)制作清算报告；</u></p> <p><u>(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；</u></p> <p><u>(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；</u></p> <p><u>(7)对基金剩余财产进行分配。</u></p> <p>5、<u>基金财产清算的期限为 6 个月，但若遇基金持有的有价证券出现长期休市、停牌或其他流通受限的情形除外。</u></p> <p>四、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剩余财产中支付。</p> <p><u>增加：五、基金财产清算剩余资产的分配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。</u></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>六、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> |
| <p>违约责任</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》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：</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，应当对直接损失承担赔偿责任。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)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。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，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责：</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、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。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> |
| <p>争议的处理</p> | <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</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，如经友好协商、调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委</p> |

| | | |
|---------------------------------------|--|--|
| | <p>易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。</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>员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p> |
| 基金合同的效力 | <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，供投资者在基金管理人、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》应经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章）。</p> <p>2、《基金合同》的有效期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> |
| 其他事项 | <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規和规定协商解决。</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規协商解决。</p> |
| <p>根据上述内容在“第二十四部分基金合同摘要”中相应修改和添加。</p> | | |

东吴基金管理有限公司

2018年5月14日