

**中小企业板交易型开放式指数基金  
基金合同**

**基金管理人：华夏基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**二零零六年五月**

## 目 录

一、前言	1
二、释义	1
三、基金的基本情况	5
四、基金份额的发售	6
五、基金备案	7
六、基金份额的交易	8
七、基金份额的申购与赎回	9
八、基金的转托管和非交易过户等其他业务	13
九、基金合同当事人及权利义务	13
十、基金份额持有人大会	18
十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	24
十二、基金的托管	25
十三、基金份额的登记	25
十四、基金的投资	26
十五、基金的财产	31
十六、基金资产的估值	32
十七、基金的费用与税收	35
十八、基金的收益与分配	36
十九、基金的会计和审计	37
二十、基金的信息披露	38
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	41
二十二、违约责任	43
二十三、争议的处理	43
二十四、基金合同的效力	44
二十五、其他事项	44
二十六、基金管理人和基金托管人签章	44

## 一、前言

(一)订立本基金合同的目的、依据和原则

1.订立本基金合同的目的是保护投资者合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(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》”)和其他有关法律法规。

3.订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益。

(二)基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

(三)中小企业板交易型开放式指数基金由基金管理人依照《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。

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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的,以基金合同为准。

## 二、释义

在本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

- 1.基金或本基金:指中小企业板交易型开放式指数基金。
- 2.基金管理人或本基金管理人:指华夏基金管理有限公司。
- 3.基金托管人或本基金托管人:指中国建设银行股份有限公司(简称“中国建设银行”)。

4.基金合同或本基金合同：指《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》及对本基金合同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《中小企业板交易型开放式指数基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充。

6.招募说明书：指《中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书》，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，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

7.基金份额发售公告：指《中小企业板交易型开放式指数基金份额发售公告》。

8.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等。

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作出的修订。

10.《销售办法》：指中国证监会于2004年6月25日颁布、自同年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订。

11.《信息披露办法》：指中国证监会于2004年6月8日颁布、自同年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订。

12.《运作办法》：指中国证监会于2004年6月29日颁布、自同年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订。

13.中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

14.银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会。

15.交易型开放式指数基金：指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”。

16.基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

17.个人投资者：指年满18周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及依据有关法律法规规定或经中国证监会核准可投资于证券投资基金的其他自然人。

18.机构投资者：指依法可以投资于证券投资基金的、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。

19.合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，

经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构。

20.投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称。

21.基金份额持有人：指依基金合同或招募说明书合法取得基金份额的投资者。

22.发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构。

23.申购赎回代理机构：指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的机构，其中，基金在深圳证券交易所场内申购、赎回业务的代理机构限于具有基金代销业务资格的证券公司，又称为代办证券公司。

24.销售代理机构：指发售代理机构和/或申购赎回代理机构。

25.直销机构：指华夏基金管理有限公司。

26.销售机构：指直销机构和/或销售代理机构。

27.基金销售网点：指直销机构的直销中心及销售代理机构的代销网点。

28.登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司（简称“中国结算”），其中，本基金份额在深圳证券交易所场内认购、上市交易以及申购、赎回等相关业务的登记结算由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（简称“中国结算深圳分公司”）负责办理。

29.登记结算业务：指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、托管和结算业务。

30.深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（简称“A股账户”）或证券投资基金账户（简称“基金账户”），投资者参与本基金在深圳证券交易所场内认购、股票认购、上市交易以及申购、赎回等业务时需具有深圳证券账户。

31.开放式基金账户：指投资者以深圳证券账户为基础、在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，投资者参与本基金场外认购、申购、赎回等业务时需具有开放式基金账户。

32.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，最长不超过3个月。

33.基金合同生效日：指募集期结束后，本基金达到法定的基金备案条件，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。

34.基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期。

35.存续期：指自基金合同生效至终止之间的不定期期限。

36.工作日：指深圳证券交易所的正常交易日。

- 37.T日：指本基金在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的日期。
- 38.T+n日：指T日后第n个工作日(不包含T日)。
- 39.开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日。
- 40.认购：指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为，投资者可以现金或股票方式申请认购。
- 41.申购：指在基金存续期内，投资者申请购买基金份额的行为，申购将导致本基金份额总数的增加。
- 42.赎回：指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为，赎回将导致本基金份额总数的减少。
- 43.申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件。
- 44.申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。
- 45.赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。
- 46.组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。
- 47.标的指数：指深圳证券交易所编制并发布的中小企业板价格指数（指数代码为399329，简称为“中小板P”）及其未来可能发生的变更，或基金管理人根据需要更换的其他代表中小企业板市场的指数。
- 48.现金替代：指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。
- 49.现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算。
- 50.最小申购、赎回单位：指本基金在深圳证券交易所场内申购份额、赎回份额的最低数量，投资者在深圳证券交易所场内申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍。
- 51.基金份额参考净值：指深圳证券交易所在交易时间内根据基金管理人提供的申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称IOPV。
- 52.预估现金部分：指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值。
- 53.元：指人民币元。

54.基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

55.基金累计报酬率：指当日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

56.标的指数累计报酬率：指当日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

57.基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。

58.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

59.基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数。

60.基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。

61.指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体。

62.不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、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等。

### 三、基金的基本情况

#### (一)基金的名称

中小企业板交易型开放式指数基金。

#### (二)基金的类别

股票基金。

#### (三)基金的运作方式

交易型开放式

#### (四)基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### (五)基金的最低募集份额总额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于 2 亿元。

#### (六)基金份额面值和认购费用

基金份额面值为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率最高不超过 1%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

#### (七)基金存续期限

不定期。

### 四、基金份额的发售

#### (一)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

##### 1.发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见招募说明书。

##### 2.发售方式

投资者可选择场内现金认购、场外现金认购以及股票认购等 3 种方式认购本基金。

场内现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以现金方式参与深圳证券交易所上网定价发售；场外现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

##### 3.发售对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资证券投资基金者除外)，合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### (二)基金份额的认购和持有限额

##### 1.认购限额

(1) 场内现金认购：场内现金认购以基金份额申请，投资者需持有深圳证券账户。单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

(2) 场外现金认购：投资者通过基金管理人办理场外现金认购的，如使用深圳证券账户，需以基金份额申请，每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)；如使用开放式基金账户，需以认购金额申请，每笔认购金额须在1000元以上(含1000元)。投资者通过发售代理机构办理场外现金认购的，需持有开放式基金账户，并以认购金额申请，每笔认购金额须在1000元以上(含1000元)。投资者可以多次认购，累计认购份额或金额不设上限。

(3) 股票认购：股票认购以单只股票股数申报，投资者需持有深圳A股账户，通过基金管理人或



发售代理机构提交申请。单只股票最低认购申报股数为1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

## 2.持有限额

本基金不设持有限额。

## (三)募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；募集的股票由登记结算机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

投资者的认购款项在基金募集期间产生的利息，在募集期结束后折算为基金份额归投资者所有，不收取认购费用。投资者的认购股票在募集冻结期间的权益归投资者所有。

本基金的认购费率最高不超过1%。

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

## 五、基金备案

### (一)基金备案的条件

1.基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额(含募集股票市值)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，基金管理人应当自募集期限届满之日起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。

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。

### (二)基金募集失败

1.基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

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，在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的认购款项并加计银行同期存款利息；对于基金募集期间募集的股票，登记结算机构应予以解冻。

### (三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，如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，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 六、基金份额的交易

### (一)基金在深圳证券交易所的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市：

- 1.基金募集金额（含募集股票市值）不低于2亿元；
- 2.基金份额持有人不少于1000人；
- 3.深圳证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告。

### (二)基金在深圳证券交易所的交易

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### (三)基金在深圳证券交易所暂停上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易：

- 1.基金不再具备本条第（一）款规定的上市条件；
- 2.基金违反法律法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3.基金严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的；
- 4.深圳证券交易所认为应当暂停基金上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所暂停基金上市的决定之日起2个工作日内在至少一种指定媒体发布基金暂停上市公告。

当暂停上市情形消除后，基金管理人应向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在至少一种指定媒体发布基金恢复上市公告。

### (四)基金在深圳证券交易所终止上市的情形和处理方式

本基金在深圳证券交易所上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易：

- 1.基金自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2.基金合同终止；
- 3.基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4.深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

发生上述终止上市情形时，基金管理人应在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工

作日内在至少一种指定媒体发布基金终止上市公告。

## 七、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 申购、赎回的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过 3 个月的时间起开始开放申购、赎回。基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在至少一种指定媒体公告。

#### 2. 开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，开放时间为9:30-11:30和13:00-15:00。基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间受理投资者的申购、赎回申请，但是对于投资者在非开放时间提出的申购、赎回申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若深圳证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

### (二) 申购和赎回场所

1. 投资者可使用深圳证券账户，采用组合证券方式，通过深圳证券交易所场内系统办理申购、赎回业务（以下简称“场内申购赎回”）。场内申购赎回代理机构为基金管理人指定的具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，又称为“代办证券公司”。

2. 投资者可使用开放式基金账户，采用现金方式，通过基金管理人和场外申购赎回代理机构办理申购、赎回业务（以下简称“场外申购赎回”）。

3. 投资者应当在基金管理人和场内、场外申购赎回代理机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外申购赎回代理机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。

4. 基金管理人将在开放申购、赎回业务之前公告场内、场外申购赎回代理机构的名单。

### (三) 申购和赎回的原则

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

(1) 基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

(2) 基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

(3) 基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2. 场外申购赎回业务须遵守中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则的规定。

(1) 基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

(2) 基金的申购对价、赎回对价为现金。

(3) 基金的申购、赎回价格基于受理申请当日申购赎回清单对应组合证券的买入成本（包括相关交易费用）或卖出价值（扣除相关交易费用）计算，与受理申请当日的基金份额净值或有不同。

3. 申购、赎回申请提交后不得撤销。

4. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

#### (四)场内申购赎回的数额限制

投资者场内申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金最小申购、赎回单位为50万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日在至少一种指定媒体公告。

#### (五)场内申购赎回的程序

##### 1. 申购和赎回申请的提出

投资者须按场内申购赎回代理机构规定的手续，在开放日的开放时间提出场内申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据当日申购赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

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

##### 3. 申购和赎回的清算交收与登记

场内申购赎回的清算交收与登记由中国结算深圳分公司负责办理。

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

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

#### (六)场内申购赎回的对价、费用及其用途

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

2.投资者在场内申购或赎回基金份额时，场内申购赎回代理机构可按照不高于0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

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

#### (七)场外申购赎回的数额限制

1.投资者每次最低申购金额为1,000元（含申购费）。

2.投资者赎回份额不设限制。

3.基金管理人有权对以上数额限制进行调整，最迟应在调整生效前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

#### (八)场外申购赎回的程序

##### 1.申购和赎回申请的提出

投资者须按基金管理人或场外申购赎回代理机构规定的手续，在开放日的开放时间提出场外申购、赎回的申请。在申请办理场外申购、赎回业务之前，投资者须确保已在基金管理人或场外申购赎回代理机构办妥开放式基金账户注册或注册确认手续。投资者申购本基金时，须全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额。

##### 2.申购和赎回申请的确认

对于T日投资者有效场外申购申请，登记结算机构最迟将于T+4日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自T+5日起有权赎回该部分基金份额。对于T日投资者有效场外赎回申请，登记结算机构最迟将于T+3日为投资者办理扣除权益的登记手续，赎回款项将在T+4日内从基金托管账户划出，经销售机构划往投资者账户。

基金管理人和登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。

##### 3.申购和赎回的清算交收与登记

场外申购赎回的清算交收与登记由中国结算负责办理，具体业务规则见招募说明书。

### (九)场外申购赎回的费用及价格

1.对于场外申购,可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取申购费,在申购时收取的申购费称为前端申购费,在赎回时收取的申购费称为后端申购费,前/后端申购费率最高均不得超过3%。

2.投资者在办理场外赎回时需交纳赎回费用,赎回费率不超过赎回总额的 1%。所收取赎回费用须依法扣除不低于 25%的部分归入基金资产,其余用作销售机构、登记结算机构的手续费。

3.基金管理人与销售机构商定后,可以调整场外申购费、赎回费的费率水平或收费方式,并报中国证监会核准或者备案后公告。

4.场外申购、赎回价格由基金管理人计算并公告。T日场外申购价格的计算公式为根据T日申购赎回清单确定的申购对价在后续交易日内的买入成本除以对价的申购份额,T日场外赎回价格的计算公式为根据T日申购赎回清单确定的赎回对价在后续交易日内的卖出价值除以赎回份额。T日场外申购价格最迟于T+4日公告,T日场外赎回价格最迟于T+3日公告。如遇特殊情况,基金管理人可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

### (十)暂停申购、赎回的情形

在如下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请:

- 1.不可抗力导致基金无法接受申购、赎回;
- 2.深圳证券交易所决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- 3.深圳证券交易所、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回;
- 4.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

由于技术系统设置原因,在发生暂停申购或赎回的情形之一时,本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的,基金管理人应当在当日报中国证监会备案,并及时公告。已接受的赎回申请,基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

此外,在发生标的指数成份股上市公司重大行为(如兼并重组)、成份股市场价格异常波动(如连续涨/跌停)等异常情形时,为避免现金申购、赎回对基金或基金份额持有人利益的不利影响,本基金管理人有权临时决定暂停接受场外申购、赎回申请,并报中国证监会备案后公告。

### (十一)集合申购与其他服务

在条件允许时,基金管理人可开放集合申购,即允许多个投资者集合其持有的组合证券,共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍,进行申购。

根据投资需要(如变更标的指数)或为提高交易便利,基金管理人可向登记结算机构申请办理基金

份额折算与变更登记。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并通知基金托管人。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并通知基金托管人。

## 八、基金的转托管和非交易过户等其他业务

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

## 九、基金合同当事人及权利义务

### (一)基金管理人

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

设立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.38 亿元

存续期间：100 年

### (二)基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

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

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币

存续期间：持续经营

### (三)基金份额持有人

投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

### (四)基金管理人的权利

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 获得基金管理人报酬；
3. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
4. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、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和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
7. 选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
8. 选择、更换销售代理机构，并依据销售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；
9. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
10. 依法召集基金份额持有人大会；



11.法律法规规定的其他权利。

(五)基金管理人的义务

- 1.依法募集基金，办理或者委托其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2.办理基金备案手续；
- 3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7.依法接受基金托管人的监督；
- 8.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10.按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- 11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12.编制中期和年度基金报告；
- 13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 18.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 19.组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22.建立并保存基金份额持有人名册；

23.法律法规规定的其他义务。

#### (六)基金托管人的权利

1.获得基金托管费；

2.监督基金管理人对本基金的投资运作；

3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6.依法召集基金份额持有人大会；

7.按规定取得基金份额持有人名册；

8.法律法规规定的其他权利。

#### (七)基金托管人的义务

1.安全保管基金财产；

2.设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3.对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7.保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8.对基金财务会计报告、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；

9.建立并保存基金份额持有人名册；

10.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11.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；

12. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
13. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
14. 按照规定监督基金管理人的投资运作；
15. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
16. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
17. 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；
18. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
19. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
20. 法律法规规定的其他义务。

#### (八) 基金份额持有人的权利

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7. 监督基金管理人的投资运作；
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (九) 基金份额持有人的义务

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 交纳基金认购、申购对价及规定的费用；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、销售代理机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## 十、基金份额持有人大会

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (二)召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上(含10%,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,应当召开基金份额持有人大会:

- (1)终止基金合同;
- (2)转换基金运作方式;
- (3)变更基金类别;
- (4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- (5)变更基金份额持有人大会议事程序;
- (6)更换基金管理人、基金托管人;
- (7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- (8)终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
- (9)本基金与其他基金的合并;
- (10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- (1)调低基金管理费、基金托管费、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、赎回费率或收费方式;
- (3)经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
- (4)经中国证监会允许,基金管理人、交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则;
- (5)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- (6)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- (7)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;
- (8)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。

### (三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集,开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

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

4.代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5.基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

#### (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 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

(1)会议召开的时间、地点和出席方式;

(2)会议拟审议的主要事项;

(3)会议形式;

(4)议事程序;

(5)有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;

(6)授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

- (7)表决方式；
- (8)会务常设联系人姓名、电话；
- (9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10)召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，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、书面表达意见的寄交和收取方式。

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。

#### (五)基金份额持有人出席会议的方式

##### 1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4)会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人的更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2.召开基金份额持有人大会的条件

###### (1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

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登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在25个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

###### (2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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；

召集人在基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）以及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；

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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

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符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

如果开会条件达不到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权参与表决的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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。

#### (六) 议事内容与程序

##### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(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前 40 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公告。

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

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

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

(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，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

基金份额持有人大会由基金管理人召集的，大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金托管人召集的，大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的，大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50% 以上多数（不含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前至少 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日统计全部有效表决，在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% 以上多数（不含 50%）通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

#### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；涉及



更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。
4. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
5. 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。

#### (八) 计票

##### 1. 现场开会

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

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

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

##### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### (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

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

(十) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一)基金管理人的更换

#### 1.基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- (1)基金管理人被依法取消其基金管理资格的；
- (2)基金管理人解散、依法撤销或依法宣告破产；
- (3)基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规和经中国证监会核准的其他情形。

#### 2.基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

- (1)提名：新任基金管理人由基金托管人提名；
- (2)决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；
- (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。更换基金管理人的决议自中国证监会依法核准之日起生效；
- (4)交接：基金管理人职责终止的，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，新任基金管理人应当及时接收；
- (5)审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支；
- (6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后 2 个工作日内公告。

### (二)基金托管人的更换

#### 1.基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1)基金托管人被依法取消其基金托管资格的；
- (2)基金托管人解散、依法撤销或依法宣布破产；
- (3)基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规和经中国证监会、银行业监督管理机构核准的其他情形。

#### 2.基金托管人的更换程序

- (1)提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

(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。更换基金托管人的决议自中国证监会依法核准之日起生效；

(4)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，及时与新任基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人应当及时接收；

(5)审计：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；

(6)公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后2个工作日内公告。

### (三)基金管理人、基金托管人同时更换

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；

2.基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3.公告：新任基金管理人和新任基金托管人在获得中国证监会核准后2个工作日内在至少一种指定媒体上联合公告。

(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，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。

## 十二、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《中小企业板交易型开放式指数基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十三、基金份额的登记

(一)本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金的登记结算业务指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、托管和结算业务。

本基金份额采用分系统登记的原则。投资者使用深圳证券账户认购、申购或通过二级市场买入的基

金份额，由中国结算深圳分公司负责办理登记结算；投资者使用开放式基金账户认购、申购的基金份额，由中国结算负责办理登记结算，登记在开放式基金账户中的基金份额只能申请赎回或转托管，不能直接在深圳证券交易所交易。

(二)基金管理人应与登记结算机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和登记结算机构在登记结算业务中的权利义务，保护投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三)登记结算机构享有如下权利：

- 1.取得登记结算费；
- 2.保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 3.在法律法规允许的范围内，对登记结算业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日内在至少一种指定媒体上公告；
- 4.法律法规规定的其他权利。

(四)登记结算机构承担如下义务：

- 1.配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 2.严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的登记结算业务；
- 3.保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录15年以上；
- 4.对基金份额持有人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5.按基金合同和招募说明书规定为投资者办理转托管、非交易过户等业务，提供基金收益分配等其他必要服务；
- 6.法律法规规定的其他义务。

## 十四、基金的投资

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(二)标的指数

本基金标的指数为深圳证券交易所编制并发布的中小企业板价格指数（指数代码为399329，简称为“中小板P”）。

如果深圳证券交易所变更或停止中小企业板价格指数的编制及发布、或中小企业板价格指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中小企业板价格指数不宜继续作为标的指数，

或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，进行适当的程序变更本基金的标的指数。其中，若标的指数变更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，并报中国证监会核准或者备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

### (三)投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

### (四)投资理念

中国经济和资本市场尤其是中小企业将长期快速增长，指数化投资可以在有效分散中小企业较高的非系统风险的基础上，以最低的成本和较低的风险获得其平均水平的回报。标的指数具有良好的代表性、流动性与成长性，通过完全复制法实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，可以满足投资者多种投资需求。

### (五)投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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。

#### 1.决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

#### 2.投资管理体制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

#### 3.投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

(1)研究支持：金融工程部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策：投资决策委员会依据金融工程部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数成份股及其权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估：金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整，并在基金招募说明书更新中公告。

#### 4.衍生品投资

为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如期权、期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资于衍生工具的目标，是使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，以便更好地实现基金的投资目标。基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的 10%。基金拟投资于新推出的金融衍生产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并报告中国证监会备案后公告。

### (六)投资组合管理

#### 1.投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

(1)确定目标组合：基金管理人根据完全复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。

(2)确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析，确定合理的建仓策略。

(3)逐步调整：根据完全复制法确定目标组合之后，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

#### 2.每日投资组合管理

(1)成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、

复牌等)信息,以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,进而进行组合调整分析,为投资决策提供依据。

(2)标的指数的跟踪与分析:跟踪标的指数编制方法的变化,确定指数变化是否与预期一致,分析是否存在差异及差异产生的原因,为投资决策提供依据。

(3)每日申购赎回情况的跟踪与分析:跟踪本基金申购和赎回信息,分析其对组合的影响。

(4)组合持有证券、现金头寸及流动性分析:基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因,并进行成份股调整的流动性分析。

(5)组合调整:

利用数量化分析模型,找出将实际组合调整到目标组合的最优方案,确定组合调整及交易策略。

如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项,可提请投资决策委员会召开会议,决定基金的操作策略。

调整组合,达到目标组合的持仓结构。

(6)复制标的指数并核对,同时根据最新的公司行为信息预测下一交易日指数结构。

(7)对比指数与组合的每日及累计的绩效数据,检测跟踪误差及其趋势。分析由于组合每只股票构成与指数构成的差异导致的跟踪误差的程度与趋势以找出跟踪误差的来源,进而决定需要对组合调整的部分及调整方法。

(8)根据指数跟踪研究结果及当日最新组合情况进行指数分析及组合分析并进行组合调整计算,进而制定明日交易内容与策略。

(9)以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础,考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况,设计 T 日申购赎回清单并公告。

### 3.定期投资组合管理

(1)每月

每月末,根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行支付现金的准备。

每月末,在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况,找出未能有效控制较大偏离的原因。

每月末,投资决策委员会可对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

(2)标的指数调整

根据标的指数的编制规则及调整公告,基金经理依据投资决策委员会的决策,在指数成份股调整生

效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少成份股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### 4.投资绩效评估

(1)每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

(2)每月末，金融工程部对本基金的运行情况进行量化评估。

(3)每月末，基金经理根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的跟踪偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。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。

#### (七)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。

#### (八)风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。

#### (九)投资限制

##### 1.投资比例限制

(1)本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；

(2)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%；

(3)本基金投资于各种衍生工具的比例合计不超过基金资产总值的 10%；

(4)本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%；

(5)本基金在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(6)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得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；

(7)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%；

(8)法律法规、基金合同以及中国证监会规定禁止的其他情形。

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(1)-(5)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

##### 2.禁止行为



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：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券（但若该证券为标的指数成份股或备选成份股，则不受此限）；
- (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；
- (8)法律法规、中国证监会规定禁止的其他活动。

3.如果法律法规对本基金合同约定的禁止行为和投资限制进行变更的，基金管理人与基金托管人商议并履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(十)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1.不谋求对所投资公司的控股或者直接管理；
- 2.所有参与行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金资产的保值和增值。

(十一)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十五、基金的财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

(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

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、销售代理机构和登记结算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

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和销售代理机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托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，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本基金财产不属于其清算财产。本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。

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。

## 十六、基金资产的估值

### (一)估值日

本基金合同生效后，每开放日对基金资产进行估值。

### (二)估值方法

#### 1.股票估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

#### (2)未上市股票的估值

送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

首次发行的股票，按成本价估值。

(3)配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价等于或低于配股价，则估值为零；

(4)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (3)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如有确凿证据表明按本项第(1) - (3)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(5)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值办法

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘净价估值；

(3)未上市债券按其成本价估值；

(4)在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值；

(5)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应采用适当的估值方法。但是，如有确凿证据表明按本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(6)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3.如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

4.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。

## (三) 估值对象

基金所拥有的股票、债券等有价值证券。

## (四) 估值程序

1.基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每开放日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应于每开放日对基金资产进行估值。基金管理人每开放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。

## (五) 估值错误的处理

1.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。

2. 差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案;

(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较大损失的,应由基金管理人先行赔付,赔偿仅限于因差错而导致的基金或基金份额持有人的直接损失。基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人带来不当得利的,基金管理人保留要求返还不当得利的权利。

(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。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资者的利益,已决定延迟估值;

4. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

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。

(八) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(4)项或债券估值方法的第(5)项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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,本基金管理人和本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，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但本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。

## 十七、基金的费用与税收

### (一)基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金上市初费及年费；
- 4.基金的证券交易费用；
- 5.基金财产划拨支付的银行费用；
- 6.基金收益分配中发生的费用；
- 7.基金合同生效后的信息披露费用；
- 8.基金份额持有人大会费用；
- 9.基金合同生效后的会计师费和律师费；
- 10.按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。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为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3.上述(一)中 3 到 10 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间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。

(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。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

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。

## 十八、基金的收益与分配

(一)基金收益的构成

- 1.买卖证券差价；
- 2.基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3.银行存款利息；
- 4.已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

(三)收益分配原则

- 1.本基金的每份基金份额享有同等分配权。
- 2.当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。
- 3.在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 2 次，若自基金合同生效日起不满

3个月可不进行收益分配。基金收益分配比例为不低于符合上述基金分红条件的可分配部分的90%。

4.本基金收益分配采取现金方式。

5.法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### (四)收益分配方案

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

#### (五)收益分配的时间和程序

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，在报中国证监会备案后2个工作日内公告；

2.在收益分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人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。

## 十九、基金的会计和审计

### (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，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

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；

5.本基金独立建账、独立核算；

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。

### (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。会计师事务所及其注册会计师须与基金管理人、基金托管人相互独立。

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和基金托管人同意，并报中国证监会备案。

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。更换会计师事务所须在备案后2个工作日内公告。

## 二十、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将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和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括：

### (一)招募说明书

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。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制招募说明书，并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。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。

### (二)基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，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。

### (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。

### (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。

### (五)基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在指定报刊及网站上公告。

### (六)基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3 个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### (七)基金资产净值公告、基金份额净值公告、申购赎回清单公告与场外申购、赎回价格公告

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之后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、申购赎回代理机构以及其他媒介，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基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

4.基金管理人将在每个开放日公告当日的申购赎回清单。

5.基金管理人最迟于T+4日公告T日场外申购价格，最迟于T+3日公告T日场外赎回价格。如遇特殊情况，基金管理人可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### (八)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

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。

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。

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。

4.基金合同生效不足 2 个月的，可不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5.法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### (九)临时报告与公告

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：

1.基金份额持有人大会的召开及决议；

2.终止基金合同；

3.转换基金运作方式；

4.更换基金管理人、基金托管人；

5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7.基金募集期延长；

8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

9.基金管理人的董事在一年内变更超过 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%；
- 11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14.重大关联交易事项；
- 15.基金收益分配事项；
- 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；
- 17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18.基金改聘会计师事务所；
- 19.基金变更、增加或减少销售代理机构；
- 20.基金更换登记结算机构；
- 21.本基金开始办理申购、赎回；
- 22.本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23.基金暂停办理申购、赎回；
- 24.本基金暂停办理申购、赎回后重新开始办理申购、赎回；
- 25.基金变更标的指数；
- 26.基金暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 27.基金份额折算与变更登记；
- 28.基金推出新业务或服务；
- 29.中国证监会规定的其他事项。

#### (十)澄清公告

在本基金合同存续期内，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和深圳证券交易所。

#### (十一)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、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金份额上市交易公告书、临时公告、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、有关销售代理机构及其网点，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者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至少一种指定媒体上公告。

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。

## 二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)基金合同的变更

1.变更基金合同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。但出现下列情况之一时，变更基金合同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告，并报中国证监会备案：

(1)因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

(2)基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的；

(3)因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

2.基金合同变更后应报中国证监会备案，并在备案后2个工作日内公告；基金合同的变更内容自公告之日起生效。

### (二)本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.基金合并、撤销；

5.中国证监会允许的其他情况。

### (三)基金财产的清算

#### 1.基金财产清算小组

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

(2)基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

## 2.基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

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

## 3.清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

## 4.基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

## 6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、违约责任

(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:

1.不可抗力;

2.基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

3.基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失或潜在损失等。

(二)基金合同当事人违反基金合同,给其他当事人造成直接经济损失的,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下,基金合同能继续履行的,应当继续履行。

(三)本基金合同一方当事人违约后,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。

(四)因第三方的过错而导致本基金合同一方当事人违约造成其他当事人损失的,违约方并不免除其赔偿责任。

(五)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。

## 二十三、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力。

在争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

## 二十四、基金合同的效力

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。

(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法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(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。

(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。

## 二十五、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

## 二十六、基金管理人和基金托管人签章

(见下页)

( 本页无正文 )

基金管理人：华夏基金管理有限公司 ( 盖章 )

法定代表人或被授权人 ( 盖章 ):

签订地：北京市

签订日：二零零六年 月

基金托管人：中国建设银行股份有限公司 ( 盖章 )

法定代表人或被授权人 ( 签字 ):

签订地：北京市

签订日：二零零六年 月